

# 国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	77
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	77
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	77
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	77
8.12 投资组合报告附注 .....	77
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>79</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	79
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	79
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>80</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>81</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	81
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	81
11.4 基金投资策略的改变 .....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
11.8 其他重大事件 .....	82
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>85</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>86</b>
13.1 备查文件目录 .....	86
13.2 存放地点 .....	86
13.3 查阅方式 .....	86

## § 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	2,120,105.71 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型方法，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	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。</p> <p>2、量化选股模型</p> <p>(1) 多因子选股策略</p> <p>1) 模型构建：本基金股票部分的构建采用 Alpha 多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量各类信息，选取估值 (Valuation)、成长 (Growth)、质量 (Quality)、市场 (Market)、和一致预期 (Forecast) 等几大类对股票超额收益具有较强解释度的因子，构建 Alpha 多因子模型，从全市场可投资股票中优选股票组合进行投资。</p> <p>2) 因子调整：本基金量化投资经理和研究人员根据市场状况的变化，定期或不定期地对模型进行复核和改进，发掘影响股票超额收益的有效因子信息，适时调整多因子的具体组成及权重，以不断改善模型的适用性。</p> <p>3) 定性优化：定性分析主要利用基本面研究成果，对</p>

	<p>模型自动选股的结果进行复核，剔除掉满足某些特殊条件的股票，即在 Alpha 多因子选股模型筛选出的股票名单中，根据分析师定性研究成果，剔除掉限制买入类股票，从而进行定性优化选择。</p> <p>本基金在股票投资过程中，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产超越业绩基准的回报。</p> <p>（2）统计套利策略</p> <p>本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内部个股之间的稳定性关系，将套利建立在对历史数据进行统计分析的基础之上，估计相关变量的概率分布进行套利操作。</p> <p>（3）事件驱动套利策略</p> <p>本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的时间以及对过往事件的数据检测，获取时间影响所带来的超额投资回报。</p> <p>（4）投资组合优化</p> <p>本基金根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整个股权重，在控制风险的前提下追求收益最大化。</p> <p>3、债券等固定收益类资产投资策略</p> <p>固定收益类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率，管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。</p> <p>（1）在债券投资方面，管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>（2）可转债投资策略</p> <p>本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，采用买入低转换溢价率的债券并持有的投资策略，密切关注可转换债券市场与股票市场之间的互动关系，选择恰当的时机进行套利，获得超额收益。</p> <p>（3）资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场</p>
--	--

	<p>进行量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资操作。</p> <p>5、股票期权投资策略。</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。</p> <p>基金管理人将根据审慎原则，建立期货期权投资决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现超额回报。</p> <p>7、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p>
业绩比较基准	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	010-66596688
	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 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100089	100818
法定代表人	邵海波	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层



## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	350,385.25	966,754.29	2,754,494.57
本期利润	327,517.25	891,839.64	3,322,052.78
加权平均基金份额本期利润	0.2480	0.1219	0.1062
本期加权平均净值利润率	16.53%	10.49%	9.35%
本期基金份额净值增长率	18.41%	18.10%	17.91%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	1,362,007.66	590,545.08	4,149,301.07
期末可供分配基金份额利润	0.6424	0.3870	0.1744
期末基金资产净值	3,482,113.37	2,116,330.63	27,943,947.39
期末基金份额净值	1.6424	1.3870	1.1744
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	64.24%	38.70%	17.44%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

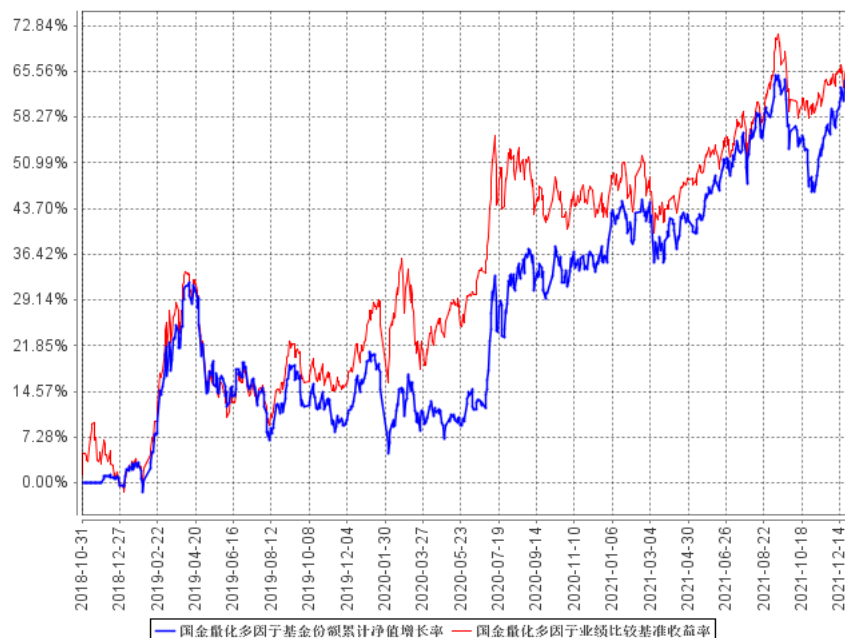
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.29%	0.83%	3.29%	0.64%	2.00%	0.19%
过去六个月	8.53%	0.95%	7.44%	0.82%	1.09%	0.13%
过去一年	18.41%	0.93%	14.20%	0.83%	4.21%	0.10%
过去三年	64.90%	1.16%	66.94%	1.17%	-2.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	64.24%	1.12%	66.27%	1.17%	-2.03%	-0.05%

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

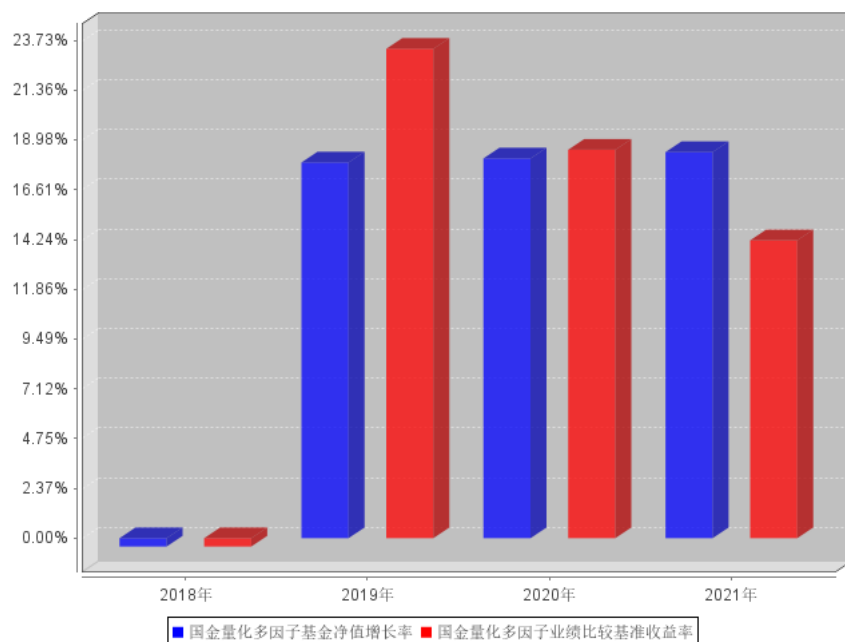
国金量化多因子基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



注：本基金的基金合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### **3.3 其他指标**

注：无

### **3.4 过去三年基金的利润分配情况**

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为49%、19.5%、19.5%、7%、1.9%、1.6%、1.5%。截至2021年12月31日，国金基金管理有限公司共管理25只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金基金经理，国金量化多策略基金经理，量化投资事业部副总经理	2020年9月3日	-	5	马芳女士，中国人民大学硕士，2003年7月至2016年5月历任华泰贝通网络科技有限公司担任IT事业部测试工程师，奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证

					券交易系统自动化测试部经理，北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理，2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理，产品中心副总经理，量化投资事业部副总经理。
--	--	--	--	--	---

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金量化多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，严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统等对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

#### 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 1.6424 元，累计单位净值为 1.6424 元，本报告期份额净值增长率为 18.41%，同期业绩比较基准增长率为 14.20%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 157 项，涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题会通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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



利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无

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

本报告期，本基金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。截至本报告期末，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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 61004823_A14 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金量化多因子股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金量化多因子股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金量化多因子股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,管理层负责评估国金量化多因子股票型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对国金量化多因子股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基</p>

	<p>于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金量化多因子股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高鹤	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2022 年 3 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	288,646.47	236,103.71
结算备付金		44,417.33	16,253.02
存出保证金		1,346.53	5,428.64
交易性金融资产	7.4.7.2	2,894,518.00	1,878,543.00
其中：股票投资		2,844,303.00	1,878,543.00
基金投资		-	-
债券投资		50,215.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	200,000.00	-
应收证券清算款		90,920.71	57,834.99
应收利息	7.4.7.5	1,467.80	48.99
应收股利		-	-
应收申购款		130,092.05	1,815.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,651,408.89	2,196,027.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		85,680.59	-
应付赎回款		15,878.57	11,923.23
应付管理人报酬		3,686.85	2,873.01
应付托管费		491.59	383.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	13,541.90	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	7.4.7.8	50,016.02	50,019.39
负债合计		169,295.52	79,697.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,120,105.71	1,525,785.55
未分配利润	7.4.7.10	1,362,007.66	590,545.08
所有者权益合计		3,482,113.37	2,116,330.63
负债和所有者权益总计		3,651,408.89	2,196,027.67

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6424 元，基金份额总额 2,120,105.71 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		470,120.42	1,317,316.64
1. 利息收入		3,047.53	9,127.50
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,307.32	8,930.66
债券利息收入		492.76	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,247.45	196.84
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		479,494.03	1,352,038.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	464,727.31	1,209,763.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	14,766.72	142,275.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-22,868.00	-74,914.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	10,446.86	31,064.85
<b>减：二、费用</b>		142,603.17	425,477.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	29,716.19	130,299.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,962.15	17,373.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	55,734.83	223,732.72
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	7.4.7.20	53,190.00	54,070.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		327,517.25	891,839.64
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		327,517.25	891,839.64

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	327,517.25	327,517.25
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）	594,320.16	443,945.33	1,038,265.49
其中：1. 基金申购款	2,435,788.44	1,378,203.44	3,813,991.88
2. 基金赎回款	-1,841,468.28	-934,258.11	-2,775,726.39
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）	2,120,105.71	1,362,007.66	3,482,113.37
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计



一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	891,839.64	891,839.64
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）	-22,268,860.77	-4,450,595.63	-26,719,456.40
其中：1. 基金申购款	5,416,757.68	980,641.81	6,397,399.49
2. 基金赎回款	-27,685,618.45	-5,431,237.44	-33,116,855.89
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）	1,525,785.55	590,545.08	2,116,330.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

          邵海波          

          聂武鹏          

          于晓莲          

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国金量化多因子股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1050号文的核准，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2018年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： $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或

权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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

#### (2) 金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

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

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

#### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

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

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

#### (4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

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

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

### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生



的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	288,646.47	236,103.71
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：	288,646.47	236,103.71

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,792,609.00	2,844,303.00	51,694.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	50,490.00	50,215.00
	银行间市场	-	-
	合计	50,490.00	50,215.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,843,099.00	2,894,518.00	51,419.00
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,804,256.00	1,878,543.00	74,287.00
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	1,804,256.00	1,878,543.00	74,287.00
----	--------------	--------------	-----------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	200,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	35.05	38.21
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	21.89	8.14
应收债券利息	1,446.16	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-35.96	-
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	0.66	2.64

合计	1,467.80	48.99
----	----------	-------

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	13,541.90	14,498.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	13,541.90	14,498.31

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	16.02	19.39
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	50,000.00	50,000.00
合计	50,016.02	50,019.39

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,525,785.55	1,525,785.55
本期申购	2,435,788.44	2,435,788.44
本期赎回（以“-”号填列）	-1,841,468.28	-1,841,468.28
- 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	2,120,105.71	2,120,105.71

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

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	689,091.49	-98,546.41	590,545.08
本期利润	350,385.25	-22,868.00	327,517.25
本期基金份额交易产生的变动数	515,962.67	-72,017.34	443,945.33
其中：基金申购款	1,670,190.00	-291,986.56	1,378,203.44
基金赎回款	-1,154,227.33	219,969.22	-934,258.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,555,439.41	-193,431.75	1,362,007.66

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	919.42	7,035.50
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	356.70	1,613.46
其他	31.20	281.70
合计	1,307.32	8,930.66

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	27,183,407.68	116,096,180.12
减：卖出股票成本总额	26,718,680.37	114,886,416.25
买卖股票差价收入	464,727.31	1,209,763.87

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

#### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

#### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

#### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

#### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

注：无

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,766.72	142,275.07
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	14,766.72	142,275.07

**7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-22,868.00	-74,914.65
——股票投资	-22,593.00	-74,914.65
——债券投资	-275.00	-
——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	-22,868.00	-74,914.65

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	10,446.86	31,064.85
合计	10,446.86	31,064.85

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

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	55,734.83	223,732.72
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	55,734.83	223,732.72

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,190.00	4,070.95
合计	53,190.00	54,070.95

### 7.4.7.21 分部报告

无

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东



苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,716.19	130,299.98
其中：支付销售机构的客户维护费	10,199.25	63,614.01

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,962.15	17,373.35

注：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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无

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

注：无

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：无

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	288,646.47	919.42	236,103.71	7,035.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

注：无

## 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司

经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	288,646.47	-	-	-	-	-	288,646.47
结算备付金	44,417.33	-	-	-	-	-	44,417.33
存出保证金	1,346.53	-	-	-	-	-	1,346.53
交易性金融资产	-	-	50,215.00	-	-	-2,844,303.00	2,894,518.00
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	-	-	200,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,467.80	1,467.80
应收证券清算款	-	-	-	-	-	90,920.71	90,920.71
应收申购款	-	-	-	-	-	130,092.05	130,092.05
资产总计	534,410.33	-	50,215.00	-	-	-3,066,783.56	3,651,408.89
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	85,680.59	85,680.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,878.57	15,878.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,686.85	3,686.85
应付托管费	-	-	-	-	-	491.59	491.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,541.90	13,541.90
其他负债	-	-	-	-	-	50,016.02	50,016.02
负债总计	-	-	-	-	-	169,295.52	169,295.52
利率敏感度缺口	534,410.33	-	50,215.00	-	-	-2,897,488.04	3,482,113.37
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)



		(%)		
交易性金融资产-股票投资	2,844,303.00	81.68	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	50,215.00	1.44	-	-
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	2,894,518.00	83.13	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。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
	分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
本期末（2021 年 12 月 31 日）			上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	+5%	142,629.57	74,714.33
	-5%	-142,629.57	-74,714.33

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

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

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,844,303.00 元，属于第二层次的余额为人民币 50,215.00 元，无属于第三层次的余额。（上年度末：属于第一层次的余额为人民币 1,878,543.00 元，无属于第二层次及第三层次的余额。）

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换（上年度：无）。本基金本报告

期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2022 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,844,303.00	77.90
	其中：股票	2,844,303.00	77.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,215.00	1.38
	其中：债券	50,215.00	1.38
	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	200,000.00	5.48
	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	333,063.80	9.12
8	其他各项资产	223,827.09	6.13
9	合计	3,651,408.89	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,704.00	0.36
B	采矿业	78,307.00	2.25
C	制造业	1,813,913.00	52.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,441.00	3.46
E	建筑业	58,501.00	1.68
F	批发和零售业	156,531.00	4.50
G	交通运输、仓储和邮政业	123,150.00	3.54
H	住宿和餐饮业	3,654.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,926.00	3.85
J	金融业	63,214.00	1.82
K	房地产业	35,976.00	1.03
L	租赁和商务服务业	51,771.00	1.49
M	科学研究和技术服务业	50,790.00	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	75,159.00	2.16

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	15,219.00	0.44
Q	卫生和社会工作	6,280.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	39,721.00	1.14
S	综合	5,046.00	0.14
	合计	2,844,303.00	81.68

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002192	融捷股份	300	39,045.00	1.12
2	300760	迈瑞医疗	100	38,080.00	1.09
3	600206	有研新材	2,100	34,398.00	0.99
4	600157	永泰能源	18,600	33,852.00	0.97
5	002304	洋河股份	200	32,946.00	0.95
6	002466	天齐锂业	300	32,100.00	0.92
7	601011	宝泰隆	5,900	31,211.00	0.90
8	603501	韦尔股份	100	31,077.00	0.89
9	300661	圣邦股份	100	30,900.00	0.89
10	002460	赣锋锂业	200	28,570.00	0.82
11	601866	中远海发	8,500	27,625.00	0.79
12	603197	保隆科技	400	23,360.00	0.67
13	601608	中信重工	5,100	22,746.00	0.65
14	002480	新筑股份	3,200	22,720.00	0.65
15	301080	百普赛斯	100	21,113.00	0.61
16	000060	中金岭南	4,200	20,622.00	0.59
17	601288	农业银行	6,700	19,698.00	0.57
18	300042	朗科科技	1,200	18,456.00	0.53
19	600710	苏美达	2,800	18,312.00	0.53
20	000709	河钢股份	7,400	18,204.00	0.52
21	605499	东鹏饮料	100	18,184.00	0.52
22	002791	坚朗五金	100	18,159.00	0.52
23	002343	慈文传媒	2,700	15,633.00	0.45
24	603332	苏州龙杰	900	15,174.00	0.44
25	300664	鹏鹞环保	2,200	14,960.00	0.43

26	603833	欧派家居	100	14,750.00	0.42
27	002221	东华能源	1,100	13,849.00	0.40
28	000159	国际实业	2,100	13,713.00	0.39
29	603893	瑞芯微	100	13,690.00	0.39
30	000498	山东路桥	2,200	13,596.00	0.39
31	300323	华灿光电	1,100	13,266.00	0.38
32	300546	雄帝科技	700	12,488.00	0.36
33	603908	牧高笛	300	12,450.00	0.36
34	603396	金辰股份	100	12,300.00	0.35
35	600282	南钢股份	3,300	12,210.00	0.35
36	002916	深南电路	100	12,182.00	0.35
37	301051	信濠光电	100	12,015.00	0.35
38	000510	新金路	2,000	11,820.00	0.34
39	300419	浩丰科技	1,500	11,700.00	0.34
40	000685	中山公用	1,300	11,505.00	0.33
41	300486	东杰智能	1,000	11,440.00	0.33
42	300568	星源材质	300	11,019.00	0.32
43	002929	润建股份	300	10,842.00	0.31
44	300723	一品红	300	10,770.00	0.31
45	002743	富煌钢构	1,500	10,740.00	0.31
46	300625	三雄极光	700	10,633.00	0.31
47	002267	陕天然气	1,400	10,318.00	0.30
48	603606	东方电缆	200	10,232.00	0.29
49	002280	联络互动	2,100	9,933.00	0.29
50	002394	联发股份	1,200	9,852.00	0.28
51	300505	川金诺	300	9,192.00	0.26
52	600549	厦门钨业	400	9,052.00	0.26
53	601216	君正集团	1,700	8,891.00	0.26
54	002845	同兴达	300	8,865.00	0.25
55	002329	皇氏集团	2,000	8,800.00	0.25
56	600231	凌钢股份	3,300	8,778.00	0.25
57	002712	思美传媒	1,700	8,568.00	0.25
58	000973	佛塑科技	1,600	8,240.00	0.24
59	300911	亿田智能	100	8,192.00	0.24
60	002110	三钢闽光	1,200	8,160.00	0.23
61	601009	南京银行	900	8,064.00	0.23
62	002977	天箭科技	100	8,006.00	0.23
63	300981	中红医疗	100	7,994.00	0.23
64	003021	兆威机电	100	7,985.00	0.23

65	300288	朗玛信息	600	7,950.00	0.23
66	300553	集智股份	200	7,762.00	0.22
67	600547	山东黄金	400	7,528.00	0.22
68	603183	建研院	1,300	7,527.00	0.22
69	000936	华西股份	1,200	7,524.00	0.22
70	605080	浙江自然	100	7,480.00	0.21
71	000028	国药一致	200	7,396.00	0.21
72	300333	兆日科技	900	7,362.00	0.21
73	002702	海欣食品	1,200	7,248.00	0.21
74	300229	拓尔思	700	7,245.00	0.21
75	002115	三维通信	1,200	7,224.00	0.21
76	600971	恒源煤电	1,100	7,106.00	0.20
77	600103	青山纸业	2,500	7,050.00	0.20
78	603817	海峡环保	1,100	6,853.00	0.20
79	603517	绝味食品	100	6,833.00	0.20
80	600455	博通股份	300	6,831.00	0.20
81	300327	中颖电子	100	6,790.00	0.19
82	002296	辉煌科技	900	6,768.00	0.19
83	603709	中源家居	400	6,744.00	0.19
84	300653	正海生物	100	6,677.00	0.19
85	002103	广博股份	1,300	6,396.00	0.18
86	300509	新美星	1,000	6,380.00	0.18
87	002687	乔治白	900	6,363.00	0.18
88	601177	杭齿前进	700	6,307.00	0.18
89	603386	广东骏亚	300	6,288.00	0.18
90	002044	美年健康	800	6,280.00	0.18
91	600567	山鹰国际	1,900	6,251.00	0.18
92	300662	科锐国际	100	6,221.00	0.18
93	600008	首创环保	1,800	6,138.00	0.18
94	600749	西藏旅游	600	6,060.00	0.17
95	600113	浙江东日	900	6,030.00	0.17
96	300359	全通教育	1,000	5,980.00	0.17
97	603324	盛剑环境	100	5,866.00	0.17
98	000544	中原环保	900	5,760.00	0.17
99	000526	学大教育	300	5,697.00	0.16
100	600768	宁波富邦	600	5,676.00	0.16
101	002054	德美化工	600	5,652.00	0.16
102	002367	康力电梯	700	5,621.00	0.16
103	603877	太平鸟	200	5,576.00	0.16

104	000623	吉林敖东	300	5,541.00	0.16
105	605177	东亚药业	200	5,528.00	0.16
106	605009	豪悦护理	100	5,499.00	0.16
107	002065	东华软件	700	5,460.00	0.16
107	600507	方大特钢	700	5,460.00	0.16
108	603155	新亚强	100	5,411.00	0.16
109	002479	富春环保	900	5,346.00	0.15
110	603985	恒润股份	100	5,342.00	0.15
111	002233	塔牌集团	500	5,290.00	0.15
112	300462	华铭智能	400	5,280.00	0.15
113	603588	高能环境	300	5,271.00	0.15
114	603790	雅运股份	500	5,265.00	0.15
115	603042	华脉科技	400	5,240.00	0.15
116	000050	深天马 A	400	5,208.00	0.15
116	600818	中路股份	600	5,208.00	0.15
117	000048	京基智农	300	5,193.00	0.15
118	300816	艾可蓝	100	5,151.00	0.15
119	002820	桂发祥	500	5,100.00	0.15
120	002901	大博医疗	100	5,062.00	0.15
121	600717	天津港	1,200	5,028.00	0.14
122	600135	乐凯胶片	600	5,004.00	0.14
123	600548	深高速	500	4,990.00	0.14
124	601366	利群股份	800	4,952.00	0.14
125	300818	耐普矿机	100	4,940.00	0.14
126	300873	海晨股份	100	4,910.00	0.14
127	600320	振华重工	1,300	4,901.00	0.14
128	601106	中国一重	1,400	4,872.00	0.14
129	002067	景兴纸业	1,200	4,848.00	0.14
130	002231	奥维通信	800	4,824.00	0.14
130	600004	白云机场	400	4,824.00	0.14
131	000026	飞亚达	400	4,740.00	0.14
132	000633	合金投资	800	4,736.00	0.14
132	600026	中远海能	800	4,736.00	0.14
133	002396	星网锐捷	200	4,714.00	0.14
134	000680	山推股份	1,100	4,708.00	0.14
135	300424	航新科技	300	4,692.00	0.13
136	002729	好利科技	100	4,664.00	0.13
137	001206	依依股份	100	4,640.00	0.13
138	600307	酒钢宏兴	2,100	4,620.00	0.13

139	002106	莱宝高科	400	4,604.00	0.13
140	300627	华测导航	100	4,600.00	0.13
141	600901	江苏租赁	900	4,581.00	0.13
142	600955	维远股份	100	4,563.00	0.13
143	300492	华图山鼎	100	4,557.00	0.13
144	600623	华谊集团	500	4,550.00	0.13
145	300864	南大环境	100	4,541.00	0.13
146	600297	广汇汽车	1,700	4,539.00	0.13
147	300790	宇瞳光学	100	4,518.00	0.13
148	300743	天地数码	400	4,500.00	0.13
149	601158	重庆水务	700	4,487.00	0.13
150	300596	利安隆	100	4,476.00	0.13
151	300470	中密控股	100	4,467.00	0.13
152	600998	九州通	300	4,416.00	0.13
153	600066	宇通客车	400	4,408.00	0.13
154	600867	通化东宝	400	4,384.00	0.13
155	603712	七一二	100	4,330.00	0.12
156	002293	罗莱生活	300	4,299.00	0.12
157	600390	五矿资本	800	4,256.00	0.12
158	002978	安宁股份	100	4,228.00	0.12
159	603689	皖天然气	400	4,208.00	0.12
160	300230	永利股份	900	4,185.00	0.12
161	300791	仙乐健康	100	4,170.00	0.12
162	603037	凯众股份	200	4,146.00	0.12
163	603989	艾华集团	100	4,140.00	0.12
164	600966	博汇纸业	400	4,136.00	0.12
165	603612	索通发展	200	4,104.00	0.12
165	603727	博迈科	200	4,104.00	0.12
166	600461	洪城环境	500	4,075.00	0.12
166	603725	天安新材	500	4,075.00	0.12
167	300753	爱朋医疗	200	4,058.00	0.12
168	600667	太极实业	500	4,040.00	0.12
169	605296	神农集团	100	4,031.00	0.12
170	002660	茂硕电源	500	4,025.00	0.12
171	002952	亚世光电	300	3,981.00	0.11
172	002195	二三四五	1,700	3,978.00	0.11
173	600648	外高桥	300	3,969.00	0.11
174	300802	矩子科技	100	3,960.00	0.11
175	300501	海顺新材	200	3,940.00	0.11



176	600785	新华百货	300	3,930.00	0.11
176	603681	永冠新材	100	3,930.00	0.11
177	300388	节能国祯	500	3,925.00	0.11
178	601997	贵阳银行	600	3,906.00	0.11
179	603915	国茂股份	100	3,890.00	0.11
180	600326	西藏天路	600	3,870.00	0.11
181	605398	新炬网络	100	3,847.00	0.11
182	600639	浦东金桥	300	3,831.00	0.11
183	603380	易德龙	100	3,830.00	0.11
184	000555	神州信息	300	3,816.00	0.11
184	002035	华帝股份	600	3,816.00	0.11
185	000900	现代投资	900	3,798.00	0.11
186	002543	万和电气	500	3,785.00	0.11
187	601200	上海环境	300	3,777.00	0.11
188	002521	齐峰新材	600	3,756.00	0.11
189	002842	翔鹭钨业	400	3,748.00	0.11
190	600697	欧亚集团	300	3,738.00	0.11
191	002224	三力士	700	3,703.00	0.11
192	000750	国海证券	900	3,699.00	0.11
193	603881	数据港	100	3,692.00	0.11
194	603203	快克股份	100	3,687.00	0.11
195	601228	广州港	1,100	3,663.00	0.11
196	603626	科森科技	300	3,627.00	0.10
197	603505	金石资源	100	3,623.00	0.10
198	600325	华发股份	600	3,612.00	0.10
199	600498	烽火通信	200	3,596.00	0.10
200	600126	杭钢股份	700	3,591.00	0.10
201	000622	恒立实业	900	3,555.00	0.10
201	300126	锐奇股份	500	3,555.00	0.10
202	600475	华光环能	300	3,552.00	0.10
203	600056	中国医药	300	3,543.00	0.10
204	605180	华生科技	100	3,530.00	0.10
205	605090	九丰能源	100	3,517.00	0.10
206	300836	佰奥智能	100	3,515.00	0.10
207	000011	深物业 A	300	3,498.00	0.10
208	002890	弘宇股份	200	3,486.00	0.10
209	002010	传化智联	400	3,480.00	0.10
210	600035	楚天高速	1,100	3,465.00	0.10
211	002877	智能自控	500	3,460.00	0.10

212	002034	旺能环境	200	3,454.00	0.10
213	600388	龙净环保	400	3,448.00	0.10
214	300862	蓝盾光电	100	3,442.00	0.10
215	603303	得邦照明	200	3,432.00	0.10
216	002399	海普瑞	200	3,420.00	0.10
217	003011	海象新材	100	3,417.00	0.10
218	600496	精工钢构	800	3,408.00	0.10
219	300897	山科智能	100	3,401.00	0.10
220	001872	招商港口	200	3,390.00	0.10
220	300561	汇金科技	300	3,390.00	0.10
221	000917	电广传媒	500	3,380.00	0.10
222	000553	安道麦 A	400	3,376.00	0.10
223	603365	水星家纺	200	3,366.00	0.10
224	603768	常青股份	200	3,348.00	0.10
225	600345	长江通信	200	3,338.00	0.10
226	605259	绿田机械	100	3,335.00	0.10
227	603579	荣泰健康	100	3,334.00	0.10
228	000906	浙商中拓	300	3,333.00	0.10
228	300331	苏大维格	100	3,333.00	0.10
229	002378	章源钨业	400	3,328.00	0.10
230	002912	中新赛克	100	3,309.00	0.10
231	603218	日月股份	100	3,295.00	0.09
232	002085	万丰奥威	600	3,294.00	0.09
233	300955	嘉亨家化	100	3,287.00	0.09
234	002892	科力尔	100	3,250.00	0.09
235	603590	康辰药业	100	3,249.00	0.09
236	300930	屹通新材	100	3,244.00	0.09
237	600073	上海梅林	400	3,236.00	0.09
238	000507	珠海港	500	3,230.00	0.09
239	002851	麦格米特	100	3,202.00	0.09
240	300512	中亚股份	200	3,192.00	0.09
241	000927	中国铁物	900	3,186.00	0.09
242	300241	瑞丰光电	400	3,184.00	0.09
242	600835	上海机电	200	3,184.00	0.09
243	000885	城发环境	300	3,180.00	0.09
244	000990	诚志股份	200	3,164.00	0.09
244	300282	三盛教育	700	3,164.00	0.09
245	300996	普联软件	100	3,159.00	0.09
246	002262	恩华药业	200	3,130.00	0.09

247	601968	宝钢包装	300	3,123.00	0.09
248	002908	德生科技	200	3,120.00	0.09
248	600575	淮河能源	1,300	3,120.00	0.09
249	603053	成都燃气	300	3,117.00	0.09
250	600420	国药现代	300	3,111.00	0.09
251	002869	金溢科技	200	3,108.00	0.09
252	300389	艾比森	300	3,099.00	0.09
253	300557	理工光科	100	3,094.00	0.09
254	000528	柳工	400	3,084.00	0.09
254	603602	纵横通信	300	3,084.00	0.09
255	002899	英派斯	200	3,078.00	0.09
256	601019	山东出版	500	3,075.00	0.09
257	603909	合诚股份	200	3,070.00	0.09
258	300815	玉禾田	100	3,058.00	0.09
259	000828	东莞控股	300	3,054.00	0.09
260	002757	南兴股份	200	3,050.00	0.09
261	002204	大连重工	700	3,045.00	0.09
262	002980	华盛昌	100	3,041.00	0.09
263	603933	睿能科技	200	3,036.00	0.09
264	603535	嘉诚国际	100	3,029.00	0.09
265	603823	百合花	200	2,980.00	0.09
266	000627	天茂集团	900	2,979.00	0.09
267	002800	天顺股份	200	2,976.00	0.09
268	002631	德尔未来	400	2,940.00	0.08
269	300145	中金环境	900	2,934.00	0.08
270	300221	银禧科技	400	2,932.00	0.08
271	002160	常铝股份	600	2,928.00	0.08
271	300851	交大思诺	100	2,928.00	0.08
272	002996	顺博合金	200	2,926.00	0.08
273	300686	智动力	200	2,912.00	0.08
274	600395	盘江股份	400	2,908.00	0.08
275	000563	陕国投 A	900	2,907.00	0.08
276	600750	江中药业	200	2,890.00	0.08
277	000881	中广核技	300	2,889.00	0.08
278	002119	康强电子	200	2,884.00	0.08
279	300401	花园生物	200	2,876.00	0.08
280	603029	天鹅股份	200	2,860.00	0.08
281	603003	龙宇燃油	400	2,856.00	0.08
282	300756	金马游乐	100	2,843.00	0.08

283	002522	浙江众成	400	2,840.00	0.08
283	600664	哈药股份	800	2,840.00	0.08
284	600012	皖通高速	400	2,832.00	0.08
285	600874	创业环保	400	2,828.00	0.08
286	002462	嘉事堂	200	2,814.00	0.08
287	300200	高盟新材	300	2,811.00	0.08
288	002061	浙江交科	500	2,790.00	0.08
289	002875	安奈儿	300	2,766.00	0.08
290	300867	圣元环保	100	2,757.00	0.08
291	600269	赣粤高速	800	2,744.00	0.08
292	000823	超声电子	200	2,724.00	0.08
293	600797	浙大网新	400	2,720.00	0.08
294	601005	重庆钢铁	1,300	2,717.00	0.08
295	002967	广电计量	100	2,708.00	0.08
296	002889	东方嘉盛	100	2,704.00	0.08
296	600643	爱建集团	400	2,704.00	0.08
297	002555	三七互娱	100	2,702.00	0.08
297	002958	青农商行	700	2,702.00	0.08
298	300422	博世科	300	2,697.00	0.08
299	603377	东方时尚	300	2,691.00	0.08
300	300252	金信诺	300	2,676.00	0.08
301	603367	辰欣药业	200	2,670.00	0.08
302	603238	诺邦股份	200	2,668.00	0.08
303	000833	粤桂股份	400	2,664.00	0.08
304	600758	辽宁能源	700	2,660.00	0.08
305	603320	迪贝电气	200	2,642.00	0.08
306	603112	华翔股份	200	2,640.00	0.08
307	002093	国脉科技	400	2,636.00	0.08
307	601886	江河集团	400	2,636.00	0.08
308	300538	同益股份	100	2,635.00	0.08
309	600582	天地科技	600	2,628.00	0.08
310	002734	利民股份	200	2,620.00	0.08
311	603356	华菱精工	200	2,610.00	0.07
312	600602	云赛智联	400	2,600.00	0.07
313	601801	皖新传媒	500	2,595.00	0.07
314	605100	华丰股份	100	2,586.00	0.07
315	002420	毅昌科技	300	2,583.00	0.07
316	002442	龙星化工	400	2,576.00	0.07
317	601900	南方传媒	300	2,568.00	0.07

318	605058	澳弘电子	100	2,546.00	0.07
319	000600	建投能源	500	2,545.00	0.07
320	002957	科瑞技术	100	2,543.00	0.07
321	603789	星光农机	200	2,528.00	0.07
322	002774	快意电梯	300	2,520.00	0.07
323	600798	宁波海运	600	2,514.00	0.07
323	603095	越剑智能	100	2,514.00	0.07
324	002866	传艺科技	200	2,512.00	0.07
325	603685	晨丰科技	200	2,504.00	0.07
326	600502	安徽建工	600	2,490.00	0.07
327	603656	泰禾智能	200	2,488.00	0.07
328	603601	再升科技	200	2,482.00	0.07
329	002758	浙农股份	200	2,478.00	0.07
329	603041	美思德	200	2,478.00	0.07
330	300583	赛托生物	100	2,468.00	0.07
331	002802	洪汇新材	100	2,459.00	0.07
332	600713	南京医药	500	2,455.00	0.07
333	300849	锦盛新材	200	2,452.00	0.07
334	600433	冠豪高新	500	2,450.00	0.07
335	002111	威海广泰	200	2,448.00	0.07
335	600846	同济科技	300	2,448.00	0.07
336	300190	维尔利	400	2,440.00	0.07
336	601225	陕西煤业	200	2,440.00	0.07
337	603323	苏农银行	500	2,435.00	0.07
338	600278	东方创业	300	2,427.00	0.07
339	002391	长青股份	300	2,424.00	0.07
340	002817	黄山胶囊	200	2,412.00	0.07
340	601975	招商南油	1,200	2,412.00	0.07
341	300349	金卡智能	200	2,410.00	0.07
342	600449	宁夏建材	200	2,406.00	0.07
342	603043	广州酒家	100	2,406.00	0.07
343	002896	中大力德	100	2,392.00	0.07
344	600551	时代出版	300	2,391.00	0.07
344	600969	郴电国际	300	2,391.00	0.07
345	002310	东方园林	800	2,384.00	0.07
346	000532	华金资本	200	2,382.00	0.07
347	300300	海峡创新	500	2,375.00	0.07
348	002661	克明食品	200	2,368.00	0.07
349	600825	新华传媒	500	2,360.00	0.07

350	000952	广济药业	300	2,349.00	0.07
351	603580	艾艾精工	200	2,346.00	0.07
352	600628	新世界	300	2,325.00	0.07
353	603353	和顺石油	100	2,323.00	0.07
354	603015	弘讯科技	300	2,319.00	0.07
355	000798	中水渔业	300	2,316.00	0.07
356	300214	日科化学	300	2,313.00	0.07
357	002083	孚日股份	500	2,305.00	0.07
358	600097	开创国际	200	2,304.00	0.07
359	300433	蓝思科技	100	2,298.00	0.07
359	603508	思维列控	100	2,298.00	0.07
360	300823	建科机械	100	2,283.00	0.07
361	002277	友阿股份	700	2,282.00	0.07
362	600467	好当家	800	2,280.00	0.07
363	601298	青岛港	400	2,276.00	0.07
364	301055	张小泉	100	2,274.00	0.07
364	600076	康欣新材	600	2,274.00	0.07
365	300132	青松股份	200	2,258.00	0.06
366	000719	中原传媒	300	2,256.00	0.06
366	600033	福建高速	800	2,256.00	0.06
367	300490	华自科技	100	2,244.00	0.06
368	002225	濮耐股份	500	2,235.00	0.06
369	600819	耀皮玻璃	400	2,232.00	0.06
370	600802	福建水泥	300	2,226.00	0.06
371	000407	胜利股份	500	2,220.00	0.06
371	000429	粤高速 A	300	2,220.00	0.06
372	002583	海能达	400	2,208.00	0.06
372	002672	东江环保	300	2,208.00	0.06
373	002868	绿康生化	200	2,206.00	0.06
374	002981	朝阳科技	100	2,193.00	0.06
375	002398	垒知集团	300	2,190.00	0.06
375	002826	易明医药	200	2,190.00	0.06
376	002159	三特索道	200	2,186.00	0.06
377	002146	荣盛发展	500	2,175.00	0.06
378	603199	九华旅游	100	2,172.00	0.06
379	600133	东湖高新	400	2,168.00	0.06
380	300582	英飞特	100	2,163.00	0.06
381	002393	力生制药	100	2,161.00	0.06
382	002678	珠江钢琴	300	2,160.00	0.06

382	600676	交运股份	500	2,160.00	0.06
383	300817	双飞股份	100	2,159.00	0.06
384	002403	爱仕达	300	2,154.00	0.06
385	600820	隧道股份	400	2,152.00	0.06
386	002051	中工国际	300	2,145.00	0.06
387	002365	永安药业	200	2,122.00	0.06
388	000882	华联股份	1,100	2,101.00	0.06
389	002871	伟隆股份	200	2,100.00	0.06
390	002741	光华科技	100	2,098.00	0.06
391	603797	联泰环保	300	2,094.00	0.06
392	002898	赛隆药业	200	2,090.00	0.06
393	002809	红墙股份	200	2,088.00	0.06
394	601718	际华集团	700	2,086.00	0.06
395	003016	欣贺股份	200	2,084.00	0.06
396	002827	高争民爆	200	2,074.00	0.06
396	300306	远方信息	200	2,074.00	0.06
397	300599	雄塑科技	200	2,072.00	0.06
398	600592	龙溪股份	200	2,070.00	0.06
399	600177	雅戈尔	300	2,067.00	0.06
399	603660	苏州科达	300	2,067.00	0.06
400	002542	中化岩土	700	2,065.00	0.06
401	603809	豪能股份	100	2,057.00	0.06
402	603189	网达软件	100	2,056.00	0.06
402	603966	法兰泰克	200	2,056.00	0.06
403	300368	汇金股份	200	2,054.00	0.06
404	600368	五洲交通	500	2,035.00	0.06
404	600716	凤凰股份	500	2,035.00	0.06
405	000639	西王食品	400	2,032.00	0.06
406	002469	三维化学	300	2,031.00	0.06
407	300321	同大股份	100	2,027.00	0.06
408	002144	宏达高科	200	2,026.00	0.06
409	002401	中远海科	200	2,024.00	0.06
410	003013	地铁设计	100	2,008.00	0.06
411	002749	国光股份	200	2,000.00	0.06
412	300533	冰川网络	100	1,999.00	0.06
413	600790	轻纺城	600	1,974.00	0.06
414	002589	瑞康医药	500	1,965.00	0.06
414	300163	先锋新材	500	1,965.00	0.06
415	600814	杭州解百	300	1,959.00	0.06

416	002887	绿茵生态	200	1,958.00	0.06
417	600370	三房巷	600	1,956.00	0.06
417	600512	腾达建设	600	1,956.00	0.06
418	600694	大商股份	100	1,951.00	0.06
419	000004	国华网安	100	1,942.00	0.06
420	603611	诺力股份	100	1,940.00	0.06
421	002186	全聚德	200	1,938.00	0.06
421	603700	宁水集团	100	1,938.00	0.06
422	603289	泰瑞机器	200	1,934.00	0.06
423	600503	华丽家族	600	1,932.00	0.06
424	002229	鸿博股份	300	1,929.00	0.06
424	002972	科安达	100	1,929.00	0.06
425	002807	江阴银行	500	1,925.00	0.06
426	300885	海昌新材	100	1,924.00	0.06
427	603585	苏利股份	100	1,918.00	0.06
428	603587	地素时尚	100	1,916.00	0.06
429	002215	诺普信	300	1,914.00	0.05
429	002379	宏创控股	600	1,914.00	0.05
429	603696	安记食品	200	1,914.00	0.05
430	300050	世纪鼎利	400	1,912.00	0.05
430	600708	光明地产	800	1,912.00	0.05
431	300284	苏交科	300	1,911.00	0.05
432	002685	华东重机	500	1,905.00	0.05
433	000045	深纺织 A	200	1,900.00	0.05
434	603980	吉华集团	300	1,896.00	0.05
435	002053	云南能投	200	1,894.00	0.05
436	002150	通润装备	300	1,890.00	0.05
436	601518	吉林高速	700	1,890.00	0.05
436	601616	广电电气	500	1,890.00	0.05
437	000560	我爱我家	600	1,884.00	0.05
437	600686	金龙汽车	300	1,884.00	0.05
438	000404	长虹华意	400	1,876.00	0.05
439	600064	南京高科	200	1,868.00	0.05
440	002816	和科达	100	1,865.00	0.05
440	601789	宁波建工	500	1,865.00	0.05
441	002360	同德化工	200	1,860.00	0.05
441	300839	博汇股份	100	1,860.00	0.05
441	600651	飞乐音响	600	1,860.00	0.05
441	603739	蔚蓝生物	100	1,860.00	0.05



442	603676	卫信康	200	1,858.00	0.05
443	603889	新澳股份	300	1,857.00	0.05
444	300281	金明精机	300	1,854.00	0.05
444	603012	创力集团	300	1,854.00	0.05
445	002713	东易日盛	300	1,848.00	0.05
446	603357	设计总院	200	1,844.00	0.05
447	002406	远东传动	300	1,839.00	0.05
448	600736	苏州高新	400	1,836.00	0.05
448	603698	航天工程	100	1,836.00	0.05
449	002042	华孚时尚	400	1,828.00	0.05
450	300621	维业股份	200	1,826.00	0.05
450	300838	浙江力诺	100	1,826.00	0.05
450	603488	展鹏科技	200	1,826.00	0.05
451	600176	中国巨石	100	1,820.00	0.05
452	002778	中晟高科	100	1,811.00	0.05
453	601512	中新集团	200	1,810.00	0.05
454	600678	四川金顶	300	1,809.00	0.05
455	605500	森林包装	100	1,805.00	0.05
456	603050	科林电气	100	1,800.00	0.05
457	603116	红蜻蜓	300	1,797.00	0.05
458	605377	华旺科技	100	1,794.00	0.05
459	002903	宇环数控	100	1,793.00	0.05
460	002318	久立特材	100	1,788.00	0.05
461	002012	凯恩股份	300	1,785.00	0.05
461	002492	恒基达鑫	300	1,785.00	0.05
462	000779	甘咨询	200	1,784.00	0.05
463	600107	美尔雅	300	1,782.00	0.05
464	603956	威派格	100	1,780.00	0.05
465	603648	畅联股份	200	1,774.00	0.05
466	002696	百洋股份	300	1,773.00	0.05
467	000417	合肥百货	400	1,764.00	0.05
467	601858	中国科传	200	1,764.00	0.05
468	600692	亚通股份	300	1,758.00	0.05
469	300196	长海股份	100	1,753.00	0.05
470	002278	神开股份	300	1,749.00	0.05
471	603839	安正时尚	200	1,742.00	0.05
472	603950	长源东谷	100	1,740.00	0.05
473	000666	经纬纺机	200	1,738.00	0.05
474	002677	浙江美大	100	1,735.00	0.05

475	002478	常宝股份	400	1,732.00	0.05
476	000697	炼石航空	200	1,724.00	0.05
476	002963	豪尔赛	100	1,724.00	0.05
477	002014	永新股份	200	1,716.00	0.05
477	601007	金陵饭店	300	1,716.00	0.05
478	603298	杭叉集团	100	1,715.00	0.05
479	603256	宏和科技	200	1,712.00	0.05
480	000716	黑芝麻	500	1,710.00	0.05
480	002591	恒大高新	300	1,710.00	0.05
480	600190	锦州港	600	1,710.00	0.05
481	603759	海天股份	100	1,707.00	0.05
482	605060	联德股份	100	1,700.00	0.05
483	002315	焦点科技	100	1,698.00	0.05
484	300380	安硕信息	100	1,696.00	0.05
485	002633	申科股份	200	1,694.00	0.05
485	300097	智云股份	200	1,694.00	0.05
486	000156	华数传媒	200	1,692.00	0.05
487	002388	新亚制程	300	1,689.00	0.05
488	002815	崇达技术	100	1,685.00	0.05
489	600630	龙头股份	300	1,680.00	0.05
490	000605	渤海股份	300	1,677.00	0.05
491	600987	航民股份	300	1,668.00	0.05
492	300637	扬帆新材	200	1,662.00	0.05
493	002737	葵花药业	100	1,646.00	0.05
494	603999	读者传媒	300	1,644.00	0.05
495	600272	开开实业	200	1,642.00	0.05
495	600528	中铁工业	200	1,642.00	0.05
496	002199	东晶电子	200	1,640.00	0.05
497	002669	康达新材	100	1,634.00	0.05
498	603926	铁流股份	100	1,629.00	0.05
499	002205	国统股份	200	1,626.00	0.05
499	300649	杭州园林	100	1,626.00	0.05
500	002211	宏达新材	400	1,624.00	0.05
501	600232	金鹰股份	300	1,623.00	0.05
502	002423	中粮资本	200	1,620.00	0.05
502	603607	京华激光	100	1,620.00	0.05
503	002381	双箭股份	200	1,616.00	0.05
504	601368	绿城水务	300	1,614.00	0.05
505	002037	保利联合	200	1,612.00	0.05

506	300607	拓斯达	100	1,600.00	0.05
507	300493	润欣科技	200	1,596.00	0.05
508	000619	海螺型材	300	1,584.00	0.05
509	000034	神州数码	100	1,583.00	0.05
510	605055	迎丰股份	200	1,580.00	0.05
511	300780	德恩精工	100	1,573.00	0.05
512	002846	英联股份	200	1,572.00	0.05
513	300535	达威股份	100	1,569.00	0.05
514	002788	鹭燕医药	200	1,562.00	0.04
515	600533	栖霞建设	500	1,550.00	0.04
516	600125	铁龙物流	300	1,548.00	0.04
517	300345	华民股份	300	1,545.00	0.04
517	300717	华信新材	100	1,545.00	0.04
518	605158	华达新材	200	1,536.00	0.04
519	000919	金陵药业	200	1,530.00	0.04
519	000950	重药控股	300	1,530.00	0.04
519	300160	秀强股份	200	1,530.00	0.04
520	002161	远望谷	300	1,524.00	0.04
521	603366	日出东方	300	1,521.00	0.04
522	300392	腾信股份	200	1,520.00	0.04
523	600635	大众公用	400	1,516.00	0.04
524	300210	森远股份	400	1,508.00	0.04
524	600894	广日股份	200	1,508.00	0.04
525	603177	德创环保	100	1,506.00	0.04
526	600439	瑞贝卡	500	1,505.00	0.04
527	000759	中百集团	300	1,503.00	0.04
528	000025	特力 A	100	1,496.00	0.04
529	002567	唐人神	200	1,494.00	0.04
530	300371	汇中股份	100	1,493.00	0.04
531	000524	岭南控股	200	1,490.00	0.04
532	002107	沃华医药	200	1,480.00	0.04
533	603706	东方环宇	100	1,479.00	0.04
534	603226	菲林格尔	200	1,478.00	0.04
535	000521	长虹美菱	400	1,468.00	0.04
535	600724	宁波富达	400	1,468.00	0.04
536	600137	浪莎股份	100	1,465.00	0.04
537	300563	神宇股份	100	1,448.00	0.04
538	002561	徐家汇	200	1,446.00	0.04
539	605368	蓝天燃气	100	1,445.00	0.04

540	600397	安源煤业	500	1,440.00	0.04
541	600169	太原重工	500	1,435.00	0.04
542	600662	外服控股	200	1,432.00	0.04
543	300700	岱勒新材	100	1,427.00	0.04
544	600689	上海三毛	200	1,426.00	0.04
545	603321	梅轮电梯	200	1,424.00	0.04
546	000691	亚太实业	300	1,422.00	0.04
547	603408	建霖家居	100	1,420.00	0.04
548	600800	渤海化学	300	1,419.00	0.04
549	002279	久其软件	300	1,416.00	0.04
549	002693	双成药业	300	1,416.00	0.04
550	002862	实丰文化	100	1,415.00	0.04
551	002931	锋龙股份	100	1,409.00	0.04
552	002295	精艺股份	200	1,408.00	0.04
553	600287	江苏舜天	300	1,407.00	0.04
554	601188	龙江交通	400	1,400.00	0.04
554	603878	武进不锈	200	1,400.00	0.04
555	002244	滨江集团	300	1,398.00	0.04
555	603528	多伦科技	200	1,398.00	0.04
556	002902	铭普光磁	100	1,381.00	0.04
557	603556	海兴电力	100	1,380.00	0.04
558	000419	通程控股	300	1,374.00	0.04
558	002999	天禾股份	200	1,374.00	0.04
559	601163	三角轮胎	100	1,371.00	0.04
560	002209	达意隆	200	1,366.00	0.04
561	002251	步步高	200	1,364.00	0.04
562	603679	华体科技	100	1,360.00	0.04
563	000023	深天地 A	100	1,359.00	0.04
564	300154	瑞凌股份	200	1,352.00	0.04
565	600266	城建发展	300	1,350.00	0.04
566	002769	普路通	200	1,342.00	0.04
567	300588	熙菱信息	100	1,340.00	0.04
567	600136	当代文体	200	1,340.00	0.04
568	603628	清源股份	100	1,337.00	0.04
569	603955	大千生态	100	1,324.00	0.04
570	603103	横店影视	100	1,321.00	0.04
571	600959	江苏有线	400	1,316.00	0.04
572	002888	惠威科技	100	1,310.00	0.04
573	600020	中原高速	400	1,308.00	0.04

574	600965	福成股份	200	1,298.00	0.04
575	000726	鲁泰 A	200	1,290.00	0.04
575	600187	国中水务	500	1,290.00	0.04
576	002849	威星智能	100	1,287.00	0.04
577	603269	海鸥股份	100	1,278.00	0.04
577	603717	天域生态	100	1,278.00	0.04
578	002962	五方光电	100	1,276.00	0.04
579	000926	福星股份	300	1,275.00	0.04
580	002718	友邦吊顶	100	1,266.00	0.04
581	600284	浦东建设	200	1,264.00	0.04
582	000603	盛达资源	100	1,258.00	0.04
583	603668	天马科技	100	1,255.00	0.04
584	002818	富森美	100	1,251.00	0.04
585	603086	先达股份	100	1,239.00	0.04
586	002883	中设股份	100	1,228.00	0.04
587	002688	金河生物	200	1,226.00	0.04
587	603898	好莱客	100	1,226.00	0.04
588	002787	华源控股	200	1,222.00	0.04
589	300615	欣天科技	100	1,218.00	0.03
590	002616	长青集团	200	1,216.00	0.03
590	603682	锦和商业	200	1,216.00	0.03
591	603829	洛凯股份	100	1,213.00	0.03
592	300732	设研院	100	1,204.00	0.03
593	601086	国芳集团	300	1,188.00	0.03
594	002397	梦洁股份	300	1,185.00	0.03
595	003002	壶化股份	100	1,176.00	0.03
596	000090	天健集团	200	1,174.00	0.03
597	002237	恒邦股份	100	1,169.00	0.03
598	600679	上海凤凰	100	1,165.00	0.03
599	300931	通用电梯	100	1,162.00	0.03
600	002910	庄园牧场	100	1,159.00	0.03
601	002404	嘉欣丝绸	200	1,152.00	0.03
602	002207	准油股份	200	1,138.00	0.03
603	600425	青松建化	300	1,137.00	0.03
604	000010	美丽生态	300	1,131.00	0.03
605	002748	世龙实业	100	1,125.00	0.03
606	002856	美芝股份	100	1,121.00	0.03
607	002066	瑞泰科技	100	1,108.00	0.03
608	603937	丽岛新材	100	1,107.00	0.03

609	003018	金富科技	100	1,105.00	0.03
610	603316	诚邦股份	200	1,104.00	0.03
611	002771	真视通	100	1,099.00	0.03
612	002228	合兴包装	300	1,095.00	0.03
613	000695	滨海能源	100	1,094.00	0.03
614	000701	厦门信达	200	1,082.00	0.03
614	601595	上海电影	100	1,082.00	0.03
615	603609	禾丰股份	100	1,024.00	0.03
616	600448	华纺股份	300	1,017.00	0.03
617	600481	双良节能	100	1,006.00	0.03
618	000702	正虹科技	200	1,000.00	0.03
619	000715	中兴商业	200	978.00	0.03
620	300665	飞鹿股份	100	976.00	0.03
621	603326	我乐家居	100	967.00	0.03
622	002550	千红制药	200	966.00	0.03
623	600650	锦江在线	100	959.00	0.03
624	300057	万顺新材	100	941.00	0.03
625	002314	南山控股	300	936.00	0.03
626	002566	益盛药业	100	904.00	0.03
627	002848	高斯贝尔	100	893.00	0.03
628	000705	浙江震元	100	888.00	0.03
629	000096	广聚能源	100	883.00	0.03
630	002327	富安娜	100	854.00	0.02
631	605001	威奥股份	100	837.00	0.02
632	000655	金岭矿业	100	829.00	0.02
633	600888	新疆众和	100	827.00	0.02
634	002099	海翔药业	100	824.00	0.02
635	601258	庞大集团	500	820.00	0.02
636	300647	超频三	100	818.00	0.02
637	601568	北元集团	100	813.00	0.02
638	603887	城地香江	100	812.00	0.02
639	000582	北部湾港	100	804.00	0.02
640	000548	湖南投资	200	802.00	0.02
641	603815	交建股份	100	797.00	0.02
642	000886	海南高速	200	794.00	0.02
642	603167	渤海轮渡	100	794.00	0.02
643	300328	宜安科技	100	785.00	0.02
644	002761	浙江建投	100	752.00	0.02
645	002528	英飞拓	200	744.00	0.02

646	002303	美盈森	200	718.00	0.02
647	300640	德艺文创	100	710.00	0.02
648	300448	浩云科技	100	704.00	0.02
649	300155	安居宝	100	697.00	0.02
650	002781	奇信股份	100	695.00	0.02
651	002571	德力股份	100	693.00	0.02
652	600228	返利科技	100	692.00	0.02
653	000520	长航凤凰	200	686.00	0.02
654	002419	天虹股份	100	628.00	0.02
655	000597	东北制药	100	622.00	0.02
656	002029	七匹狼	100	618.00	0.02
657	002137	实益达	100	605.00	0.02
658	600811	东方集团	200	602.00	0.02
659	000541	佛山照明	100	565.00	0.02
660	600681	百川能源	100	553.00	0.02
661	600609	金杯汽车	100	533.00	0.02
662	002627	三峡旅游	100	532.00	0.02
663	000088	盐田港	100	530.00	0.02
664	600782	新钢股份	100	528.00	0.02
665	000797	中国武夷	200	522.00	0.01
666	600561	江西长运	100	503.00	0.01
667	002482	广田集团	200	486.00	0.01
668	600527	江南高纤	200	480.00	0.01
669	300010	豆神教育	100	419.00	0.01
670	600960	渤海汽车	100	399.00	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600893	航发动力	134,572.00	6.36
2	603799	华友钴业	130,418.00	6.16
3	300760	迈瑞医疗	118,492.00	5.60
4	002594	比亚迪	103,627.00	4.90
5	603290	斯达半导	94,583.00	4.47
6	002475	立讯精密	86,339.00	4.08

7	300677	英科医疗	82,352.00	3.89
8	600760	中航沈飞	74,104.00	3.50
9	002714	牧原股份	71,808.00	3.39
10	002304	洋河股份	71,469.00	3.38
11	002460	赣锋锂业	71,267.00	3.37
12	300223	北京君正	70,908.00	3.35
13	603993	洛阳钼业	70,002.00	3.31
14	000661	长春高新	69,892.00	3.30
15	002407	多氟多	68,795.00	3.25
16	300390	天华超净	67,167.00	3.17
17	300274	阳光电源	66,542.00	3.14
18	601600	中国铝业	66,166.00	3.13
19	300014	亿纬锂能	66,155.00	3.13
20	002466	天齐锂业	66,057.00	3.12
21	603026	石大胜华	65,868.00	3.11
22	600362	江西铜业	65,477.00	3.09
23	002415	海康威视	64,709.00	3.06
24	300999	金龙鱼	63,381.00	2.99
25	300661	圣邦股份	62,056.00	2.93
26	600809	山西汾酒	61,970.00	2.93
27	002977	火箭科技	60,543.00	2.86
28	002326	永太科技	60,504.00	2.86
29	601799	星宇股份	60,360.00	2.85
30	300601	康泰生物	60,353.00	2.85
31	300759	康龙化成	59,890.00	2.83
32	601888	中国中免	58,303.00	2.75
33	000002	万科 A	58,005.00	2.74
34	002812	恩捷股份	57,042.00	2.70
35	603345	安井食品	56,842.00	2.69
36	300841	康华生物	55,735.00	2.63
37	002709	天赐材料	55,709.00	2.63
38	000825	太钢不锈	55,645.00	2.63
39	300763	锦浪科技	55,439.00	2.62
40	000960	锡业股份	55,402.00	2.62
41	603259	药明康德	55,085.00	2.60
42	000933	神火股份	54,939.00	2.60



43	603501	韦尔股份	54,415.00	2.57
44	603489	八方股份	53,684.00	2.54
45	002985	北摩高科	53,466.00	2.53
46	300073	当升科技	53,261.00	2.52
47	600019	宝钢股份	51,600.00	2.44
48	002371	北方华创	51,281.00	2.42
49	000858	五粮液	50,258.00	2.37
50	002791	坚朗五金	49,977.00	2.36
51	300015	爱尔眼科	49,944.00	2.36
52	600206	有研新材	49,798.00	2.35
53	000596	古井贡酒	49,790.00	2.35
54	600570	恒生电子	48,495.00	2.29
55	600409	三友化工	48,337.00	2.28
56	600460	士兰微	47,356.00	2.24
57	600188	兖矿能源	47,150.00	2.23
58	601168	西部矿业	46,905.00	2.22
59	000932	华菱钢铁	46,729.00	2.21
60	601005	重庆钢铁	46,543.00	2.20
61	300221	银禧科技	46,524.00	2.20
62	002230	科大讯飞	46,440.00	2.19
63	601398	工商银行	46,429.00	2.19
64	002156	通富微电	46,178.00	2.18
65	000568	泸州老窖	45,843.00	2.17
66	600499	科达制造	45,756.00	2.16
67	601001	晋控煤业	45,592.00	2.15
68	600048	保利发展	45,561.00	2.15
69	002601	龙佰集团	45,487.00	2.15
70	600546	山煤国际	44,920.00	2.12
71	300776	帝尔激光	44,750.00	2.11
72	002074	国轩高科	44,689.00	2.11
73	300059	东方财富	44,297.00	2.09
74	601225	陕西煤业	44,261.00	2.09
75	300413	芒果超媒	43,796.00	2.07
76	002759	天际股份	43,588.00	2.06
77	600436	片仔癀	42,432.00	2.00
78	600219	南山铝业	42,413.00	2.00

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603799	华友钴业	137,507.00	6.50
2	600893	航发动力	135,340.00	6.40
3	603290	斯达半导	129,721.00	6.13
4	002594	比亚迪	122,763.00	5.80
5	000661	长春高新	119,516.00	5.65
6	002714	牧原股份	101,920.00	4.82
7	002475	立讯精密	94,194.00	4.45
8	601888	中国中免	91,278.00	4.31
9	300274	阳光电源	88,072.00	4.16
10	300677	英科医疗	87,271.00	4.12
11	300760	迈瑞医疗	85,091.00	4.02
12	600362	江西铜业	82,346.00	3.89
13	601799	星宇股份	77,878.00	3.68
14	603345	安井食品	77,791.00	3.68
15	300601	康泰生物	77,481.00	3.66
16	300759	康龙化成	76,061.00	3.59
17	600760	中航沈飞	74,618.00	3.53
18	603259	药明康德	72,227.00	3.41
19	002812	恩捷股份	72,116.00	3.41
20	600436	片仔癀	70,950.00	3.35
21	000568	泸州老窖	70,781.00	3.34
22	603993	洛阳钼业	70,358.00	3.32
23	601600	中国铝业	70,073.00	3.31
24	002415	海康威视	69,668.00	3.29
25	000596	古井贡酒	69,362.00	3.28
26	000002	万科 A	68,647.00	3.24
27	300223	北京君正	67,619.00	3.20
28	603026	石大胜华	66,526.00	3.14
29	300014	亿纬锂能	65,789.00	3.11
30	300390	天华超净	64,686.00	3.06
31	300841	康华生物	64,500.00	3.05
32	002304	洋河股份	63,555.00	3.00

33	002407	多氟多	63,405.00	3.00
34	300782	卓胜微	61,900.00	2.92
35	600809	山西汾酒	61,295.00	2.90
36	603195	公牛集团	61,255.00	2.89
37	300751	迈为股份	60,505.00	2.86
38	002326	永太科技	58,896.00	2.78
39	000825	太钢不锈	58,762.00	2.78
40	300124	汇川技术	58,252.00	2.75
41	002709	天赐材料	57,380.00	2.71
42	300763	锦浪科技	57,107.00	2.70
43	002977	天箭科技	55,376.00	2.62
44	603986	兆易创新	54,891.00	2.59
45	603501	韦尔股份	54,667.00	2.58
46	000960	锡业股份	53,863.00	2.55
47	300776	帝尔激光	53,363.00	2.52
48	300999	金龙鱼	53,363.00	2.52
49	002985	北摩高科	52,841.00	2.50
50	300073	当升科技	52,804.00	2.50
51	000933	神火股份	52,749.00	2.49
52	000858	五粮液	52,503.00	2.48
53	600019	宝钢股份	52,446.00	2.48
54	002371	北方华创	51,444.00	2.43
55	300413	芒果超媒	50,478.00	2.39
56	002460	赣锋锂业	49,716.00	2.35
57	002791	坚朗五金	48,531.00	2.29
58	300015	爱尔眼科	48,405.00	2.29
59	300769	德方纳米	48,305.00	2.28
60	601168	西部矿业	47,728.00	2.26
61	002230	科大讯飞	47,661.00	2.25
62	002074	国轩高科	47,094.00	2.23
63	002156	通富微电	46,346.00	2.19
64	300221	银禧科技	46,088.00	2.18
65	600499	科达制造	45,881.00	2.17
66	601398	工商银行	45,728.00	2.16
67	600188	兖矿能源	45,637.00	2.16
68	600219	南山铝业	45,636.00	2.16
69	603489	八方股份	45,524.00	2.15
70	600460	士兰微	45,467.00	2.15

71	000932	华菱钢铁	45,442.00	2.15
72	601001	晋控煤业	45,311.00	2.14
73	600887	伊利股份	43,883.00	2.07
74	002601	龙佰集团	43,499.00	2.06
75	601633	长城汽车	43,469.00	2.05
76	600570	恒生电子	43,291.00	2.05
77	601005	重庆钢铁	43,001.00	2.03
78	600546	山煤国际	42,428.00	2.00
79	600409	三友化工	42,402.00	2.00

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	27,707,033.37
卖出股票收入（成交）总额	27,183,407.68

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,215.00	1.44
	其中：政策性金融债	50,215.00	1.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,215.00	1.44

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	500	50,215.00	1.44

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

注：无

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：无

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：无

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

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

注：无

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

报告期内未对股指期货进行投资。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

报告期内本基金未对国债期货进行投资。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：无

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金报告期内未参与国债期货投资。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，宝泰隆新材料股份有限公司于 2021 年 11 月 15 日受到黑龙江省七台河市生态环境局给予罚款 30 万元的行政处罚。

国家开发银行于 2021 年 1 月 8 日受到中国银保监会给予罚款 4880 万元的行政处罚。

韦尔股份于 2021 年 5 月 1 日受到中国证监会上海监管局给予警告函的行政处罚。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制

日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,346.53
2	应收证券清算款	90,920.71
3	应收股利	-
4	应收利息	1,467.80
5	应收申购款	130,092.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	223,827.09

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,186	1,787.61	-	-	2,120,105.71	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	119,127.75	5.6190%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无

## § 10 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	2,435,788.44
减:本报告期基金总赎回份额	1,841,468.28
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	2,120,105.71

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未改变基金投资策略。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东方证券	1	32,450,455.00	59.12%	13,996.89	59.11%	-
招商证券	2	22,439,986.05	40.88%	9,680.70	40.89%	-

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》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

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

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	50,490.00	100.00%	11,300,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 1 月 22 日
2	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 18 日
3	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2020 年年度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日

		站	
4	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 2 日
5	《国金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
6	《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
7	《国金量化多因子股票型证券投资基金托管协议》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
8	《国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
9	《国金量化多因子股票型证券投资基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
10	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 21 日
11	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 12 日
12	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 19 日
13	《国金基金管理有限公司关于股	规定披露媒体和本	2021 年 7 月 10 日

	权变更及修改公司章程的公告》	基金基金管理人网 站	
14	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2021 年 7 月 20 日
15	《国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2021 年 7 月 23 日
16	《国金量化多因子股票型证券投资基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2021 年 7 月 23 日
17	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2021 年 7 月 24 日
18	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年中期报告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2021 年 8 月 27 日
19	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告》	规定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2021 年 10 月 27 日

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

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金量化多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。

### 13.2 存放地点

本基金基金管理人及托管人住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、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

2022 年 3 月 30 日