

# 国金量化多因子股票型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 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 2022 年 8 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未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 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>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	73
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>74</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	74
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>75</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>76</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
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.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>79</b>

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.....	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>80</b>
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	80

## § 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	23,670,840.97 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	95566
	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	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(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	1,404,084.86
本期利润	2,427,458.69
加权平均基金份额本期利润	0.4141
本期加权平均净值利润率	25.61%
本期基金份额净值增长率	8.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	18,602,516.69
期末可供分配基金份额利润	0.7859
期末基金资产净值	42,273,357.66
期末基金份额净值	1.7859
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	78.59%

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	11.28%	1.25%	6.02%	0.94%	5.26%	0.31%
过去三个月	11.35%	1.88%	2.02%	1.48%	9.33%	0.40%
过去六个月	8.74%	1.69%	-10.12%	1.38%	18.86%	0.31%
过去一年	18.01%	1.36%	-3.44%	1.13%	21.45%	0.23%
过去三年	52.92%	1.20%	28.91%	1.14%	24.01%	0.06%
自基金合同	78.59%	1.21%	49.44%	1.20%	29.15%	0.01%

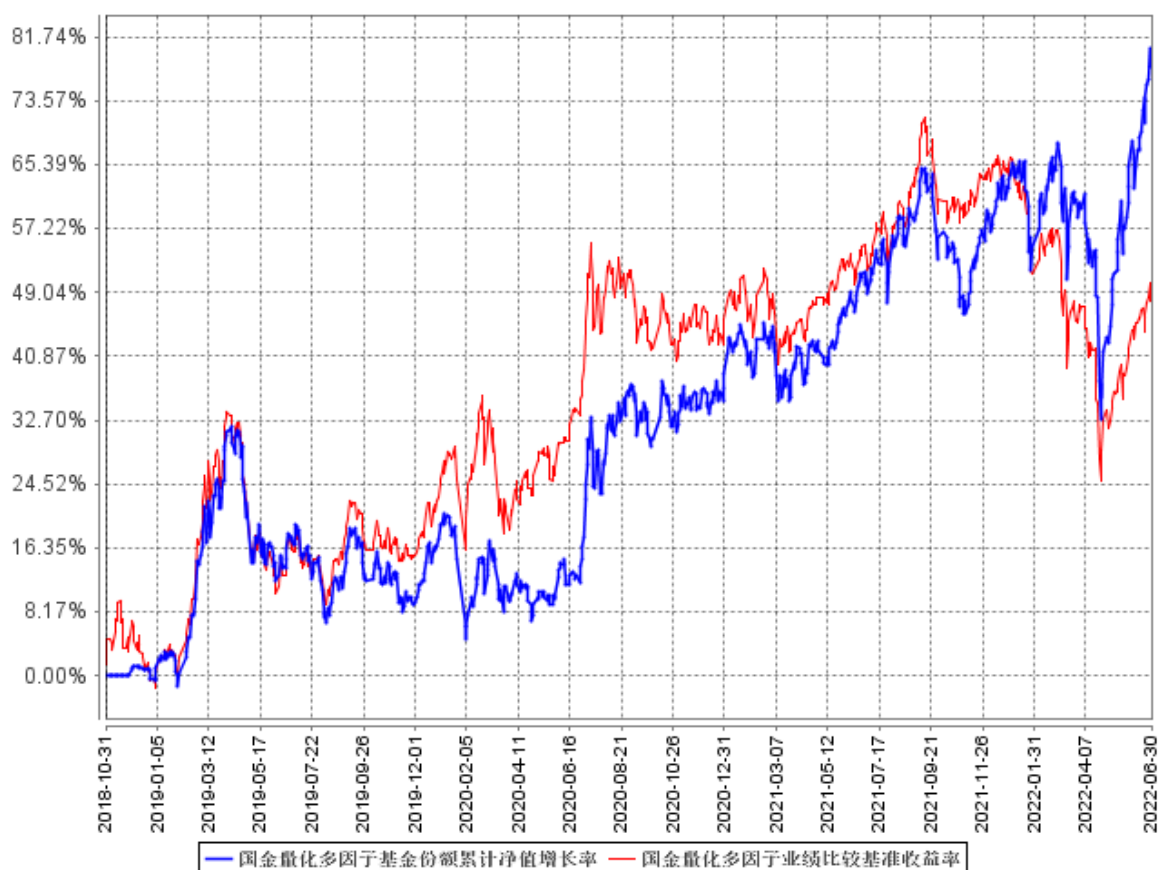


生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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 2022 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、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为49%、19.5%、19.5%、7%、1.5%、1.9%和1.6%。截至2022年6月30日，国金基金管理有限公司共管理28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、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金惠利纯债债券型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金基金经理，国金量化多策略、国金量化精选基	2020年9月3日	-	6	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

	金经理， 量化投 资事业 部副总 经理			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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金以基本面结合市场情绪变量为基础，利用机器学习方法构建模型，通过预测市场风格因子等标的获取超额收益。2022 年上半年市场波动有较为明显的提升，市场风格和行业变化较快，机会较为分散，一定程度上利于量化策略获取超额收益。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 1.7859 元，累计单位净值为 1.7859 元，本报告期份额净值增长率为 8.74%，同期业绩比较基准增长率为-10.12%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

量化策略对市场风格的极端表现较为敏感，市场风格相对均衡，机会分散的市场环境利于量化策略运作。

## 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,162,521.23	288,646.47
结算备付金		176,693.79	44,417.33
存出保证金		5,420.25	1,346.53
交易性金融资产	6.4.7.2	33,992,803.30	2,894,518.00
其中：股票投资		33,992,803.30	2,844,303.00
基金投资		-	-
债券投资		-	50,215.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,800,000.00	200,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	90,920.71
应收股利		-	-
应收申购款		4,689,872.85	130,092.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,467.80
资产总计		47,827,311.42	3,651,408.89
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,655,108.89	85,680.59

应付赎回款		791,615.55	15,878.57
应付管理人报酬		26,670.88	3,686.85
应付托管费		3,556.11	491.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	77,002.33	63,557.92
负债合计		5,553,953.76	169,295.52
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	23,670,840.97	2,120,105.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	18,602,516.69	1,362,007.66
净资产合计		42,273,357.66	3,482,113.37
负债和净资产总计		47,827,311.42	3,651,408.89

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7859 元，基金份额总额 23,670,840.97 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,531,776.93	210,764.32
1.利息收入		6,152.50	1,069.28
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,764.32	605.58
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		3,388.18	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）		1,441,905.04	280,585.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,381,339.49	271,164.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	18.84	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	60,546.71	9,420.51
以摊余成本计量的金融资		-	-



产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,023,373.83	-72,858.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	60,345.56	1,968.57
<b>减：二、营业总支出</b>		104,318.24	57,838.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	67,956.91	12,997.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,060.90	1,733.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	27,300.43	43,107.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,427,458.69	152,925.97
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,427,458.69	152,925.97
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,427,458.69	152,925.97

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,120,105.71	-	1,362,007.66	3,482,113.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,120,105.71	-	1,362,007.66	3,482,113.37

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	21,550,735.26	-	17,240,509.03	38,791,244.29
(一)、综合收益总额	-	-	2,427,458.69	2,427,458.69
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	21,550,735.26	-	14,813,050.34	36,363,785.60
其中: 1.基金申购款	27,973,374.44	-	18,761,631.58	46,735,006.02
2.基金赎回款	-6,422,639.18	-	-3,948,581.24	-10,371,220.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	23,670,840.97	-	18,602,516.69	42,273,357.66
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,525,785.55	-	590,545.08	2,116,330.63
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,525,785.55	-	590,545.08	2,116,330.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-461,264.55	-	-44,114.07	-505,378.62
(一)、综合收益总额	-	-	152,925.97	152,925.97
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-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
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,064,521.00	-	546,431.01	1,610,952.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

          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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国金量化多因子股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1050 号文的核准，由国金基金管理有限公司于 2018 年 9 月 10 日至 2018 年 10 月 26 日向社会公开募集，基金合同于 2018 年 10 月 31 日生效。首次募集规模为 249,293,966.03 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货合约和股票期权需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为： $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务

的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

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

##### (1) 金融资产分类

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

##### (2) 金融负债分类

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

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且

符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

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

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

#### 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

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

关税费后的净额入账；

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

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

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

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

#### 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

无

#### 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

##### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

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

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

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

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 288,646.47 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 35.05 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 288,681.52 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 44,417.33 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 21.89 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 44,439.22 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,346.53 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.66 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,347.19 元。



买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 200,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币-35.96 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 199,964.04 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 130,092.05 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 130,092.05 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1467.80 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 35.05 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 21.89 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.66 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 1,446.16 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币-35.96 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 50,215.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,446.16 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 51,661.16 元。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	7,162,521.23
等于：本金	7,162,029.10
加：应计利息	492.13
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	7,162,521.23

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	32,918,010.47	-	33,992,803.30	1,074,792.83
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	32,918,010.47	-	33,992,803.30	1,074,792.83
----	---------------	---	---------------	--------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,800,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	376.41
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	51,830.73
其中：交易所市场	51,830.73
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	24,795.19
合计	77,002.33

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

本期期初	2,120,105.71	2,120,105.71
本期申购	27,973,374.44	27,973,374.44
本期赎回(以“-”号填列)	-6,422,639.18	-6,422,639.18
- 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	23,670,840.97	23,670,840.97

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,555,439.41	-193,431.75	1,362,007.66
本期利润	1,404,084.86	1,023,373.83	2,427,458.69
本期基金份额交易产生的变动数	16,769,414.31	-1,956,363.97	14,813,050.34
其中：基金申购款	21,607,286.59	-2,845,655.01	18,761,631.58
基金赎回款	-4,837,872.28	889,291.04	-3,948,581.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,728,938.58	-1,126,421.89	18,602,516.69

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	1,959.81
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	778.41
其他	26.10
合计	2,764.32

#### 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	55,912,204.01
减：卖出股票成本总额	54,402,784.90
减：交易费用	128,079.62
买卖股票差价收入	1,381,339.49

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	508.84
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-490.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	18.84

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	51,955.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,490.00
减：应计利息总额	1,955.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-490.00

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无



6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	60,546.71
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	60,546.71

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,023,373.83
——股票投资	1,023,098.83
——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	1,023,373.83

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	60,331.53
转出费收入	14.03
合计	60,345.56

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。

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：无

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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	2,505.24
合计	27,300.43

## 6.4.7.24 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	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
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：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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	67,956.91	12,997.84
其中：支付销售机构的客户维护费	27,128.50	4,222.94

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,060.90	1,733.03

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国银行股份有限公司	7,162,521.23	1,959.81	262,919.43	448.50

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：本基金本报告期末未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2022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》、《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。

#### 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 2022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	7,162,521.23	-	-	-	-	-	7,162,521.23
结算备付金	176,693.79	-	-	-	-	-	176,693.79
存出保证金	5,420.25	-	-	-	-	-	5,420.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	33,992,803.30	33,992,803.30

买入返售金融资产	1,800,000.00	-	-	-	-	-	1,800,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	4,689,872.85	4,689,872.85
资产总计	9,144,635.27	-	-	-	-	38,682,676.15	47,827,311.42
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,655,108.89	4,655,108.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	791,615.55	791,615.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,670.88	26,670.88
应付托管费	-	-	-	-	-	3,556.11	3,556.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	51,830.73	51,830.73
其他负债	-	-	-	-	-	25,171.60	25,171.60
负债总计	-	-	-	-	-	5,553,953.76	5,553,953.76
利率敏感度缺口	9,144,635.27	-	-	-	-	-33,128,722.39	42,273,357.66
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	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
应收证券清算款	-	-	-	-	-	90,920.71	90,920.71
应收利息	-	-	-	-	-	1,467.80	1,467.80
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

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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	33,992,803.30	80.41	2,844,303.00	81.68
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	33,992,803.30	80.41	2,844,303.00	81.68

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。	
	分析	相关风险变量的变动

		30 日 )	31 日 )
	5%	1,935,244.91	142,629.57
	-5%	-1,935,244.91	-142,629.57

#### 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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
	-	-	-
	合计	-	-

注:无

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	33,992,803.30	2,844,303.00
第二层次	-	50,215.00
第三层次	-	-
合计	33,992,803.30	2,894,518.00

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### **6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### **6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

#### **6.4.15 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	33,992,803.30	71.07
	其中：股票	33,992,803.30	71.07
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	1,800,000.00	3.76
	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	7,339,215.02	15.35
8	其他各项资产	4,695,293.10	9.82
9	合计	47,827,311.42	100.00

### 7.2 报告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	69,010.00	0.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,497,468.80	57.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,540.00	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	14,690.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,062,026.50	19.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	142,600.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	354,354.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	651,067.00	1.54
O	居民服务、修理和其他服务业	55,328.00	0.13

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,584.00	0.03
S	综合	125,135.00	0.30
	合计	33,992,803.30	80.41

### 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	300397	天和防务	39,000	405,990.00	0.96
2	300045	华力创通	52,800	404,976.00	0.96
3	300537	广信材料	32,900	404,670.00	0.96
4	300389	艾比森	38,900	404,171.00	0.96
5	300659	中孚信息	19,000	404,130.00	0.96
6	300424	航新科技	35,400	399,312.00	0.94
7	300830	金现代	50,300	387,813.00	0.92
8	300017	网宿科技	68,000	364,480.00	0.86
9	300302	同有科技	44,000	356,400.00	0.84
10	300440	运达科技	53,600	355,368.00	0.84
11	600645	中源协和	18,200	354,354.00	0.84
12	002308	威创股份	91,000	350,350.00	0.83
13	300116	保力新	170,200	343,804.00	0.81
14	300768	迪普科技	21,150	341,572.50	0.81
15	300719	安达维尔	33,300	340,659.00	0.81
16	300183	东软载波	23,000	340,170.00	0.80
17	300180	华峰超纤	81,400	326,414.00	0.77
18	300168	万达信息	34,100	321,904.00	0.76
19	300467	迅游科技	27,300	319,137.00	0.75
20	300925	法本信息	26,620	318,109.00	0.75
21	300430	诚益通	31,000	317,440.00	0.75
22	300002	神州泰岳	76,500	315,945.00	0.75
23	300213	佳讯飞鸿	56,100	315,282.00	0.75
24	600410	华胜天成	53,700	313,608.00	0.74
25	300735	光弘科技	30,000	313,500.00	0.74

26	300931	通用电梯	40,300	311,519.00	0.74
27	002456	欧菲光	45,900	307,989.00	0.73
28	301082	久盛电气	16,500	306,075.00	0.72
29	300540	蜀道装备	13,700	302,359.00	0.72
30	300134	大富科技	36,400	296,660.00	0.70
31	300252	金信诺	38,100	294,132.00	0.70
32	300098	高新兴	80,200	292,730.00	0.69
33	300300	海峡创新	68,600	286,062.00	0.68
34	000997	新大陆	21,600	285,336.00	0.67
35	300493	润欣科技	39,700	275,121.00	0.65
36	300562	乐心医疗	27,900	269,793.00	0.64
37	002796	世嘉科技	34,100	264,616.00	0.63
38	300141	和顺电气	27,400	263,588.00	0.62
39	300634	彩讯股份	20,700	262,890.00	0.62
40	300265	通光线缆	29,300	257,840.00	0.61
41	300241	瑞丰光电	45,000	255,600.00	0.60
42	300950	德固特	15,500	252,650.00	0.60
43	300968	格林精密	27,000	244,620.00	0.58
44	300512	中亚股份	29,450	241,490.00	0.57
45	300588	熙菱信息	22,600	240,012.00	0.57
46	300333	兆日科技	35,600	239,232.00	0.57
47	300521	爱司凯	21,300	239,199.00	0.57
48	300641	正丹股份	35,600	237,452.00	0.56
49	603283	赛腾股份	11,100	236,985.00	0.56
50	300211	亿通科技	27,500	236,775.00	0.56
51	300439	美康生物	19,300	234,302.00	0.55
52	002151	北斗星通	7,400	233,544.00	0.55
53	300829	金丹科技	7,100	230,182.00	0.54
54	002172	澳洋健康	62,300	228,641.00	0.54
55	300314	戴维医疗	21,500	228,330.00	0.54
56	300616	尚品宅配	8,000	227,600.00	0.54
57	002161	远望谷	44,400	222,444.00	0.53
58	300441	鲍斯股份	32,900	222,075.00	0.53
59	002947	恒铭达	12,010	220,984.00	0.52
60	300136	信维通信	13,100	220,735.00	0.52
61	301056	森赫股份	25,200	218,232.00	0.52
62	300414	中光防雷	26,000	217,360.00	0.51
63	300123	亚光科技	34,800	215,760.00	0.51
64	300462	华铭智能	22,100	212,823.00	0.50



65	002622	融钰集团	66,200	211,840.00	0.50
66	000823	超声电子	20,400	210,936.00	0.50
67	300365	恒华科技	30,100	210,700.00	0.50
68	300867	圣元环保	10,000	209,200.00	0.49
69	603686	福龙马	20,600	204,352.00	0.48
70	300637	扬帆新材	26,700	201,051.00	0.48
71	300838	浙江力诺	13,100	200,299.00	0.47
72	300971	博亚精工	8,100	199,665.00	0.47
73	300579	数字认证	7,800	195,000.00	0.46
74	300582	英飞特	12,700	192,278.00	0.45
75	300899	上海凯鑫	8,600	190,920.00	0.45
76	002084	海鸥住工	48,300	190,302.00	0.45
77	603106	恒银科技	36,800	189,520.00	0.45
78	603042	华脉科技	18,400	189,152.00	0.45
79	301128	强瑞技术	6,200	187,550.00	0.44
80	002156	通富微电	12,100	186,340.00	0.44
81	605122	四方新材	10,300	185,400.00	0.44
82	300234	开尔新材	28,900	184,093.00	0.44
83	300877	金春股份	11,100	183,816.00	0.43
84	603389	亚振家居	33,100	182,050.00	0.43
85	600797	浙大网新	30,700	181,744.00	0.43
86	300429	强力新材	18,800	178,412.00	0.42
87	300959	线上线下	5,600	178,360.00	0.42
88	603337	杰克股份	8,300	178,284.00	0.42
89	300908	仲景食品	4,700	176,861.00	0.42
90	301002	崧盛股份	6,740	167,623.80	0.40
91	600955	维远股份	5,800	167,272.00	0.40
92	300689	澄天伟业	9,200	159,252.00	0.38
93	300514	友讯达	15,200	158,536.00	0.38
94	300232	洲明科技	24,200	157,784.00	0.37
95	300150	世纪瑞尔	39,000	157,170.00	0.37
96	002584	西陇科学	19,600	156,212.00	0.37
97	300566	激智科技	8,500	153,850.00	0.36
98	300385	雪浪环境	23,300	152,615.00	0.36
99	301028	东亚机械	13,600	147,152.00	0.35
100	300030	阳普医疗	20,200	147,056.00	0.35
101	300453	三鑫医疗	14,500	144,130.00	0.34
102	300076	GQY 视讯	30,200	141,638.00	0.34
103	300749	项固集创	18,900	139,293.00	0.33

104	300906	日月明	5,500	137,225.00	0.32
105	300816	艾可蓝	4,500	136,710.00	0.32
106	300488	恒锋工具	5,400	134,838.00	0.32
107	300542	新晨科技	11,200	128,800.00	0.30
108	002835	同为股份	12,900	127,581.00	0.30
109	002983	芯瑞达	6,200	127,286.00	0.30
110	301016	雷尔伟	6,800	126,820.00	0.30
111	002730	电光科技	14,800	125,800.00	0.30
112	300067	安诺其	35,600	125,668.00	0.30
113	000551	创元科技	14,500	125,135.00	0.30
114	300419	浩丰科技	22,800	124,032.00	0.29
115	300923	研奥股份	5,000	115,250.00	0.27
116	605088	冠盛股份	8,300	111,884.00	0.26
117	300717	华信新材	8,200	110,700.00	0.26
118	300921	南凌科技	5,600	110,040.00	0.26
119	300230	永利股份	28,500	109,155.00	0.26
120	301178	天亿马	3,300	108,999.00	0.26
121	603976	正川股份	4,400	108,284.00	0.26
122	002115	三维通信	24,400	101,260.00	0.24
123	300889	爱克股份	7,000	99,960.00	0.24
124	603679	华体科技	9,100	99,736.00	0.24
125	301009	可靠股份	7,900	98,592.00	0.23
126	001211	双枪科技	4,000	98,400.00	0.23
127	300227	光韵达	13,200	96,888.00	0.23
128	300277	海联讯	13,800	96,462.00	0.23
129	603718	海利生物	8,400	96,432.00	0.23
130	300995	奇德新材	4,500	96,300.00	0.23
131	003036	泰坦股份	8,900	95,319.00	0.23
132	002658	雪迪龙	13,300	93,499.00	0.22
133	002231	奥维通信	14,000	93,380.00	0.22
134	000691	亚太实业	20,800	90,272.00	0.21
135	002522	浙江众成	15,800	89,744.00	0.21
136	002919	名臣健康	4,500	89,145.00	0.21
137	300402	宝色股份	4,300	86,645.00	0.20
138	300624	万兴科技	2,700	86,373.00	0.20
139	002199	东晶电子	12,800	86,272.00	0.20
140	605259	绿田机械	3,000	85,680.00	0.20
141	301053	远信工业	3,600	84,096.00	0.20
142	300549	优德精密	6,000	82,560.00	0.20

143	300868	杰美特	4,600	82,248.00	0.19
144	002634	棒杰股份	17,000	81,600.00	0.19
145	002980	华盛昌	3,100	81,282.00	0.19
146	300289	利德曼	12,500	78,625.00	0.19
147	300096	易联众	11,700	78,390.00	0.19
148	300615	欣天科技	7,100	78,242.00	0.19
149	603385	惠达卫浴	10,200	77,214.00	0.18
150	300448	浩云科技	14,200	76,112.00	0.18
151	300155	安居宝	13,600	75,480.00	0.18
152	300669	沪宁股份	7,800	73,632.00	0.17
153	301086	鸿富瀚	1,200	72,660.00	0.17
154	300862	蓝盾光电	2,600	70,408.00	0.17
155	300913	兆龙互连	4,400	69,828.00	0.17
156	300800	力合科技	4,200	69,468.00	0.16
157	300511	雪榕生物	10,300	69,010.00	0.16
158	300922	天秦装备	3,800	68,248.00	0.16
159	300069	金利华电	3,500	67,585.00	0.16
160	300417	南华仪器	6,800	66,980.00	0.16
161	300380	安硕信息	4,600	66,884.00	0.16
162	300884	狄耐克	6,400	66,176.00	0.16
163	300779	惠城环保	4,900	65,807.00	0.16
164	002845	同兴达	3,300	65,670.00	0.16
165	300721	怡达股份	1,800	64,926.00	0.15
166	003027	同兴环保	3,700	64,565.00	0.15
167	301042	安联锐视	1,900	63,498.00	0.15
168	300845	捷安高科	4,500	61,200.00	0.14
169	600768	宁波富邦	6,600	60,588.00	0.14
170	300145	中金环境	21,900	60,225.00	0.14
171	300092	科新机电	5,800	58,406.00	0.14
172	002827	高争民爆	5,900	57,997.00	0.14
173	300246	宝莱特	3,600	56,700.00	0.13
174	605179	一鸣食品	4,000	56,560.00	0.13
175	002689	远大智能	11,200	56,336.00	0.13
176	300563	神宇股份	4,600	55,752.00	0.13
177	002165	红宝丽	11,900	55,692.00	0.13
178	300736	百邦科技	5,600	55,328.00	0.13
179	300875	捷强装备	1,500	55,215.00	0.13
180	603516	淳中科技	4,400	54,472.00	0.13
181	300557	理工光科	2,000	54,400.00	0.13

182	000566	海南海药	11,700	53,469.00	0.13
183	300711	广哈通信	4,600	53,360.00	0.13
184	300642	透景生命	2,300	52,164.00	0.12
185	300154	瑞凌股份	8,900	52,065.00	0.12
186	001216	华瓷股份	4,000	51,400.00	0.12
187	002298	中电兴发	7,700	50,512.00	0.12
188	300107	建新股份	9,400	49,914.00	0.12
189	300281	金明精机	8,000	44,800.00	0.11
190	300805	电声股份	5,200	41,340.00	0.10
191	001207	联科科技	2,400	40,824.00	0.10
192	300466	赛摩智能	7,400	40,552.00	0.10
193	300625	三雄极光	3,200	38,464.00	0.09
194	300935	盈建科	1,200	37,536.00	0.09
195	300445	康斯特	3,200	36,672.00	0.09
196	300644	南京聚隆	2,300	36,455.00	0.09
197	603626	科森科技	4,700	34,921.00	0.08
198	002816	和科达	2,000	34,840.00	0.08
199	300942	易瑞生物	1,500	34,650.00	0.08
200	603226	菲林格尔	6,800	34,204.00	0.08
201	300176	派生科技	6,300	33,957.00	0.08
202	300823	建科机械	1,700	33,133.00	0.08
203	002950	奥美医疗	2,600	32,812.00	0.08
204	002573	清新环境	5,600	32,536.00	0.08
205	300640	德艺文创	5,500	32,450.00	0.08
206	002362	汉王科技	2,300	31,786.00	0.08
207	300964	本川智能	1,000	31,190.00	0.07
208	603321	梅轮电梯	4,700	30,597.00	0.07
209	603488	展鹏科技	4,100	29,356.00	0.07
210	300789	唐源电气	1,400	28,238.00	0.07
211	300126	锐奇股份	4,600	27,876.00	0.07
212	300743	天地数码	2,300	26,565.00	0.06
213	000955	欣龙控股	5,700	25,479.00	0.06
214	300591	万里马	4,200	24,234.00	0.06
215	300658	延江股份	2,500	22,900.00	0.05
216	603880	南卫股份	3,600	21,096.00	0.05
217	300242	佳云科技	6,400	21,056.00	0.05
218	300895	铜牛信息	700	20,314.00	0.05
219	301067	显盈科技	500	19,730.00	0.05
220	603268	松发股份	1,000	19,320.00	0.05

221	300851	交大思诺	800	18,976.00	0.04
222	300756	金马游乐	1,100	17,600.00	0.04
223	300103	达刚控股	2,100	17,136.00	0.04
224	301093	华兰股份	500	16,945.00	0.04
225	300960	通业科技	900	16,848.00	0.04
226	300535	达威股份	1,200	16,536.00	0.04
227	300501	海顺新材	1,100	16,456.00	0.04
228	001202	炬申股份	1,000	14,690.00	0.03
229	300965	恒宇信通	300	14,151.00	0.03
230	300880	迦南智能	900	13,257.00	0.03
231	301041	金百泽	600	11,826.00	0.03
232	600234	科新发展	1,200	10,824.00	0.03
233	600715	文投控股	4,200	10,584.00	0.03
234	603828	柯利达	3,100	10,540.00	0.02
235	002890	弘宇股份	600	10,038.00	0.02
236	605507	国邦医药	400	9,660.00	0.02
237	300522	世名科技	800	9,632.00	0.02
238	300865	大宏立	400	8,600.00	0.02
239	001206	依依股份	200	6,630.00	0.02
240	002855	捷荣技术	800	6,280.00	0.01
241	300578	会畅通讯	300	5,109.00	0.01
242	300594	朗进科技	300	5,100.00	0.01
243	300321	同大股份	300	4,866.00	0.01
244	603615	茶花股份	600	4,596.00	0.01
245	003015	日久光电	400	3,764.00	0.01
246	603059	倍加洁	200	3,758.00	0.01
247	603768	常青股份	200	3,192.00	0.01
248	300798	锦鸡股份	300	2,205.00	0.01
249	603326	我乐家居	200	1,568.00	0.00
250	001209	洪兴股份	100	1,522.00	0.00
251	300449	汉邦高科	300	1,512.00	0.00

## 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	300659	中孚信息	521,158.00	14.97
2	300537	广信材料	440,463.00	12.65
3	300389	艾比森	410,851.00	11.80
4	300424	航新科技	407,931.00	11.72
5	300045	华力创通	406,191.00	11.67
6	300397	天和防务	401,275.00	11.52
7	300830	金现代	380,779.00	10.94
8	300017	网宿科技	363,017.00	10.43
9	300241	瑞丰光电	352,380.00	10.12
10	600645	中源协和	352,190.00	10.11
11	300302	同有科技	349,796.00	10.05
12	300116	保力新	343,664.00	9.87
13	002308	威创股份	342,188.00	9.83
14	300440	运达科技	338,515.00	9.72
15	300300	海峡创新	337,503.00	9.69
16	300719	安达维尔	336,436.00	9.66
17	300467	迅游科技	321,942.00	9.25
18	300180	华峰超纤	320,633.00	9.21
19	002221	东华能源	320,005.00	9.19
20	300768	迪普科技	318,549.00	9.15
21	300002	神州泰岳	317,891.00	9.13
22	300540	蜀道装备	315,890.00	9.07
23	300925	法本信息	314,747.00	9.04
24	300168	万达信息	313,129.00	8.99
25	300931	通用电梯	311,835.00	8.96
26	300183	东软载波	310,699.00	8.92
27	300430	诚益通	308,826.00	8.87
28	600410	华胜天成	308,666.00	8.86
29	300213	佳讯飞鸿	306,738.00	8.81
30	301082	久盛电气	304,294.00	8.74
31	300735	光弘科技	303,041.00	8.70
32	002123	梦网科技	300,267.00	8.62
33	300252	金信诺	282,916.00	8.12
34	300212	易华录	280,780.00	8.06
35	300582	英飞特	278,915.00	8.01
36	300590	移为通信	276,523.00	7.94

37	000997	新大陆	276,344.00	7.94
38	300134	大富科技	275,923.00	7.92
39	300161	华中数控	275,891.00	7.92
40	300493	润欣科技	274,183.00	7.87
41	300562	乐心医疗	270,437.00	7.77
42	002456	欧菲光	265,420.00	7.62
43	300098	高新兴	264,963.00	7.61
44	301056	森赫股份	263,457.00	7.57
45	300211	亿通科技	261,572.00	7.51
46	300634	彩讯股份	261,289.00	7.50
47	300265	通光线缆	259,908.00	7.46
48	300097	智云股份	258,658.00	7.43
49	002796	世嘉科技	257,489.00	7.39
50	300588	熙菱信息	255,625.00	7.34
51	300365	恒华科技	245,683.00	7.06
52	300968	格林精密	245,677.00	7.06
53	300333	兆日科技	243,918.00	7.00
54	300512	中亚股份	243,901.00	7.00
55	300950	德固特	243,683.00	7.00
56	300641	正丹股份	242,286.00	6.96
57	300657	弘信电子	240,191.00	6.90
58	300838	浙江力诺	239,742.00	6.88
59	300899	上海凯鑫	239,551.00	6.88
60	300521	爱司凯	237,278.00	6.81
61	300141	和顺电气	236,448.00	6.79
62	300731	科创新源	234,196.00	6.73
63	300314	戴维医疗	234,026.00	6.72
64	300439	美康生物	233,895.00	6.72
65	002622	融钰集团	232,915.00	6.69
66	605122	四方新材	231,370.00	6.64
67	603960	克来机电	228,004.00	6.55
68	002151	北斗星通	226,713.00	6.51
69	300616	尚品宅配	225,677.00	6.48
70	300414	中光防雷	222,387.00	6.39
71	300891	惠云钛业	219,835.00	6.31
72	603897	长城科技	218,124.00	6.26

73	002165	红宝丽	215,528.00	6.19
74	603283	赛腾股份	214,264.00	6.15
75	300713	英可瑞	213,442.00	6.13
76	002172	澳洋健康	212,443.00	6.10
77	300829	金丹科技	211,904.00	6.09
78	300225	金力泰	211,732.00	6.08
79	301128	强瑞技术	211,483.00	6.07
80	300462	华铭智能	210,938.00	6.06
81	300867	圣元环保	210,452.00	6.04
82	603686	福龙马	206,696.00	5.94
83	300132	青松股份	206,623.00	5.93
84	300707	威唐工业	206,414.00	5.93
85	002947	恒铭达	206,351.00	5.93
86	300136	信维通信	205,255.00	5.89
87	300441	鲍斯股份	205,122.00	5.89
88	300937	药易购	203,633.00	5.85
89	300581	晨曦航空	202,727.00	5.82
90	300072	海新能科	202,636.00	5.82
91	300877	金春股份	201,256.00	5.78
92	300123	亚光科技	200,940.00	5.77
93	300579	数字认证	200,128.00	5.75
94	300383	光环新网	200,080.00	5.75
95	002161	远望谷	196,572.00	5.65
96	002084	海鸥住工	195,399.00	5.61
97	300222	科大智能	195,224.00	5.61
98	300971	博亚精工	195,096.00	5.60
99	600110	诺德股份	194,982.00	5.60
100	300637	扬帆新材	194,259.00	5.58
101	300385	雪浪环境	193,261.00	5.55
102	002824	和胜股份	192,277.51	5.52
103	603160	汇顶科技	190,307.00	5.47
104	000823	超声电子	189,661.00	5.45
105	601311	骆驼股份	188,223.00	5.41
106	300077	国民技术	188,092.00	5.40
107	600223	鲁商发展	187,410.00	5.38
108	603106	恒银科技	186,872.06	5.37



109	300055	万邦达	186,775.00	5.36
110	300234	开尔新材	185,435.00	5.33
111	603337	杰克股份	185,064.00	5.31
112	601678	滨化股份	184,229.00	5.29
113	300818	耐普矿机	183,770.00	5.28
114	000811	冰轮环境	181,706.00	5.22
115	300293	蓝英装备	181,703.00	5.22
116	300721	怡达股份	179,605.00	5.16
117	300959	线上线下	179,032.00	5.14
118	603042	华脉科技	177,444.00	5.10
119	300623	捷捷微电	177,251.00	5.09
120	600797	浙大网新	176,812.00	5.08
121	002488	金固股份	176,359.00	5.06
122	300857	协创数据	175,832.00	5.05
123	000782	美达股份	174,980.00	5.03
124	600114	东睦股份	173,523.00	4.98
125	300143	盈康生命	172,941.00	4.97
126	300460	惠伦晶体	172,294.00	4.95
127	603389	亚振家居	171,850.00	4.94
128	603048	浙江黎明	171,638.00	4.93
129	002156	通富微电	171,182.00	4.92
130	300456	赛微电子	171,149.00	4.92
131	300689	澄天伟业	171,099.00	4.91
132	002298	中电兴发	169,601.00	4.87
133	600641	万业企业	169,473.00	4.87
134	300219	鸿利智汇	169,436.00	4.87
135	600338	西藏珠峰	168,296.00	4.83
136	600955	维远股份	167,826.00	4.82
137	300908	仲景食品	166,660.00	4.79
138	301002	崧盛股份	166,400.00	4.78
139	300429	强力新材	166,299.00	4.78
140	002802	洪汇新材	163,237.60	4.69
141	300745	欣锐科技	162,273.00	4.66
142	300453	三鑫医疗	161,114.00	4.63
143	300490	华自科技	161,103.00	4.63
144	002128	电投能源	160,819.00	4.62

145	002975	博杰股份	160,080.00	4.60
146	300226	上海钢联	159,459.00	4.58
147	002284	亚太股份	159,008.00	4.57
148	300514	友讯达	158,801.00	4.56
149	300943	春晖智控	158,654.00	4.56
150	300757	罗博特科	158,432.00	4.55
151	300150	世纪瑞尔	155,744.00	4.47
152	000691	亚太实业	153,694.00	4.41
153	605088	冠盛股份	153,464.00	4.41
154	605020	永和股份	149,791.00	4.30
155	002584	西陇科学	148,474.00	4.26
156	301028	东亚机械	147,865.00	4.25
157	003029	吉大正元	147,697.00	4.24
158	300566	激智科技	147,506.00	4.24
159	300375	鹏翎股份	147,229.00	4.23
160	300644	南京聚隆	145,662.00	4.18
161	300419	浩丰科技	145,293.00	4.17
162	300232	洲明科技	144,053.00	4.14
163	300816	艾可蓝	143,791.00	4.13
164	300030	阳普医疗	143,506.00	4.12
165	300052	中青宝	143,237.00	4.11
166	300085	银之杰	142,988.00	4.11
167	300868	杰美特	142,921.00	4.10
168	002886	沃特股份	141,637.00	4.07
169	300736	百邦科技	141,279.00	4.06
170	300749	顶固集创	140,549.00	4.04
171	300091	金通灵	139,711.00	4.01
172	603093	南华期货	139,537.00	4.01
173	300076	GQY 视讯	139,429.00	4.00
174	002466	天齐锂业	139,216.00	4.00
175	300906	日月明	138,565.00	3.98
176	603186	华正新材	138,306.00	3.97
177	300563	神宇股份	138,128.00	3.97
178	002199	东晶电子	136,822.00	3.93
179	002730	电光科技	134,127.00	3.85
180	300921	南凌科技	133,947.00	3.85

181	300472	新元科技	133,852.00	3.84
182	300221	银禧科技	133,033.00	3.82
183	603121	华培动力	132,459.00	3.80
184	603650	彤程新材	132,318.00	3.80
185	000551	创元科技	132,030.00	3.79
186	300488	恒锋工具	131,980.00	3.79
187	603320	迪贝电气	131,324.00	3.77
188	300067	安诺其	130,445.00	3.75
189	301051	信濠光电	130,299.00	3.74
190	300366	创意信息	129,916.00	3.73
191	603026	石大胜华	129,800.00	3.73
192	300655	晶瑞电材	127,425.00	3.66
193	002983	芯瑞达	127,056.00	3.65
194	300985	致远新能	126,606.00	3.64
195	300069	金利华电	125,871.00	3.61
196	603917	合力科技	124,816.00	3.58
197	301016	雷尔伟	124,560.00	3.58
198	002835	同为股份	123,490.00	3.55
199	603516	淳中科技	123,434.00	3.54
200	300243	瑞丰高材	123,346.00	3.54
201	601137	博威合金	123,334.00	3.54
202	300538	同益股份	121,737.00	3.50
203	300923	研奥股份	121,383.00	3.49
204	000537	广宇发展	121,374.00	3.49
205	300056	中创环保	121,355.00	3.49
206	300421	力星股份	121,331.00	3.48
207	601519	大智慧	121,224.00	3.48
208	603976	正川股份	119,737.00	3.44
209	300151	昌红科技	118,897.00	3.41
210	600297	广汇汽车	118,891.00	3.41
211	300546	雄帝科技	118,252.00	3.40
212	002611	东方精工	117,508.00	3.37
213	603663	三祥新材	117,161.00	3.36
214	300995	奇德新材	117,034.00	3.36
215	002375	亚厦股份	116,921.00	3.36
216	002281	光迅科技	116,348.00	3.34

217	300620	光库科技	116,268.00	3.34
218	300276	三丰智能	116,049.00	3.33
219	002792	通宇通讯	114,814.00	3.30
220	300542	新晨科技	114,491.00	3.29
221	300230	永利股份	114,248.00	3.28
222	601126	四方股份	112,901.00	3.24
223	300107	建新股份	112,900.00	3.24
224	300193	佳士科技	112,220.00	3.22
225	300457	赢合科技	111,935.00	3.21
226	300405	科隆股份	111,370.00	3.20
227	603068	博通集成	111,272.00	3.20
228	600753	东方银星	111,007.00	3.19
229	300717	华信新材	110,993.00	3.19
230	603681	永冠新材	110,470.00	3.17
231	301178	天亿马	110,285.00	3.17
232	002115	三维通信	110,170.00	3.16
233	300228	富瑞特装	109,201.00	3.14
234	002978	安宁股份	108,365.00	3.11
235	300698	万马科技	108,001.00	3.10
236	002912	中新赛克	107,894.00	3.10
237	000821	京山轻机	107,811.00	3.10
238	002026	山东威达	106,482.00	3.06
239	301036	双乐股份	106,230.00	3.05
240	603507	振江股份	106,219.00	3.05
241	600418	江淮汽车	106,217.00	3.05
242	603683	晶华新材	104,515.00	3.00
243	003036	泰坦股份	104,464.00	3.00
244	603633	徕木股份	104,167.00	2.99
245	300889	爱克股份	104,160.00	2.99
246	300688	创业黑马	103,899.00	2.98
247	600386	北巴传媒	103,886.00	2.98
248	600363	联创光电	103,820.00	2.98
249	002011	盾安环境	103,799.00	2.98
250	603738	泰晶科技	103,077.00	2.96
251	301009	可靠股份	102,733.00	2.95
252	002054	德美化工	102,110.00	2.93

253	001211	双枪科技	101,562.00	2.92
254	002420	毅昌科技	101,521.00	2.92
255	300650	太龙股份	101,392.00	2.91
256	300342	天银机电	100,969.00	2.90
257	002198	嘉应制药	100,947.00	2.90
258	300473	德尔股份	100,832.00	2.90
259	601339	百隆东方	100,639.00	2.89
260	600399	抚顺特钢	100,188.00	2.88
261	002231	奥维通信	99,365.00	2.85
262	300543	朗科智能	98,837.00	2.84
263	600653	申华控股	98,650.00	2.83
264	002634	棒杰股份	98,389.00	2.83
265	002790	瑞尔特	98,253.00	2.82
266	300684	中石科技	97,729.00	2.81
267	000996	中国中期	97,345.00	2.80
268	300913	兆龙互连	96,626.00	2.77
269	603679	华体科技	96,259.00	2.76
270	002360	同德化工	96,215.00	2.76
271	300602	飞荣达	96,160.00	2.76
272	002988	豪美新材	96,151.00	2.76
273	600673	东阳光	95,831.00	2.75
274	605069	正和生态	95,804.00	2.75
275	301083	百胜智能	95,709.00	2.75
276	002402	和而泰	95,396.00	2.74
277	603936	博敏电子	95,390.00	2.74
278	600321	正源股份	95,070.00	2.73
279	603718	海利生物	94,738.00	2.72
280	002658	雪迪龙	94,592.00	2.72
281	600623	华谊集团	94,436.00	2.71
282	002436	兴森科技	94,382.00	2.71
283	300557	理工光科	94,353.00	2.71
284	002655	共达电声	94,329.00	2.71
285	300195	长荣股份	94,020.00	2.70
286	300277	海联讯	93,902.00	2.70
287	002369	卓翼科技	93,881.00	2.70
288	300320	海达股份	93,773.00	2.69

289	300667	必创科技	93,615.00	2.69
290	600330	天通股份	93,451.00	2.68
291	002483	润邦股份	93,064.00	2.67
292	600458	时代新材	92,900.00	2.67
293	002431	棕榈股份	92,802.00	2.67
294	002825	纳尔股份	92,697.00	2.66
295	603776	永安行	92,600.00	2.66
296	301053	远信工业	92,559.00	2.66
297	300624	万兴科技	92,503.00	2.66
298	300690	双一科技	92,429.00	2.65
299	300131	英唐智控	91,968.00	2.64
300	002970	锐明技术	91,442.00	2.63
301	600774	汉商集团	91,244.00	2.62
302	600985	淮北矿业	91,227.00	2.62
303	002527	新时达	90,867.00	2.61
304	603725	天安新材	90,472.00	2.60
305	002196	方正电机	90,031.00	2.59
306	000099	中信海直	89,901.00	2.58
307	000503	国新健康	89,880.00	2.58
308	300552	万集科技	89,715.00	2.58
309	002213	大为股份	89,427.00	2.57
310	002010	传化智联	89,366.00	2.57
311	002780	三夫户外	89,089.00	2.56
312	000626	远大控股	88,947.00	2.55
313	300380	安硕信息	88,892.00	2.55
314	603997	继峰股份	88,727.00	2.55
315	002278	神开股份	88,528.00	2.54
316	300358	楚天科技	88,519.00	2.54
317	300922	天秦装备	88,444.00	2.54
318	002922	伊戈尔	88,077.00	2.53
319	300402	宝色股份	87,997.00	2.53
320	603105	芯能科技	87,854.00	2.52
321	300484	蓝海华腾	87,750.00	2.52
322	603518	锦泓集团	87,491.00	2.51
323	002381	双箭股份	87,105.00	2.50
324	600493	凤竹纺织	87,103.00	2.50

325	603030	全筑股份	86,942.00	2.50
326	300218	安利股份	86,817.00	2.49
327	600180	瑞茂通	86,098.00	2.47
328	300769	德方纳米	85,760.00	2.46
329	300510	金冠股份	85,750.00	2.46
330	603990	麦迪科技	85,681.00	2.46
331	002522	浙江众成	85,631.00	2.46
332	603893	瑞芯微	85,332.00	2.45
333	002892	科力尔	85,325.00	2.45
334	002201	正威新材	84,951.00	2.44
335	300227	光韵达	84,589.00	2.43
336	300545	联得装备	84,561.00	2.43
337	605259	绿田机械	84,242.00	2.42
338	600011	华能国际	83,743.00	2.40
339	002931	锋龙股份	83,361.00	2.39
340	300092	科新机电	83,344.00	2.39
341	002919	名臣健康	83,295.00	2.39
342	600079	人福医药	83,291.00	2.39
343	300465	高伟达	82,469.00	2.37
344	002520	日发精机	82,335.00	2.36
345	300872	天阳科技	81,773.00	2.35
346	000959	首钢股份	81,401.00	2.34
347	002980	华盛昌	81,338.00	2.34
348	601588	北辰实业	81,215.00	2.33
349	300549	优德精密	81,193.00	2.33
350	600362	江西铜业	80,975.00	2.33
351	300842	帝科股份	80,849.00	2.32
352	000677	恒天海龙	80,843.00	2.32
353	300281	金明精机	80,798.00	2.32
354	300920	润阳科技	80,476.00	2.31
355	003022	联泓新科	80,289.00	2.31
356	300162	雷曼光电	80,217.00	2.30
357	300669	沪宁股份	80,101.00	2.30
358	600433	冠豪高新	80,062.00	2.30
359	300382	斯莱克	80,020.00	2.30
360	603318	水发燃气	79,771.00	2.29

361	600111	北方稀土	79,683.00	2.29
362	000831	五矿稀土	79,582.00	2.29
363	300289	利德曼	79,414.00	2.28
364	300827	上能电气	79,401.00	2.28
365	000423	东阿阿胶	79,166.00	2.27
366	000507	珠海港	79,050.00	2.27
367	600712	南宁百货	78,969.00	2.27
368	301149	隆华新材	78,845.00	2.26
369	600231	凌钢股份	78,398.00	2.25
370	300480	光力科技	78,371.00	2.25
371	300772	运达股份	78,149.00	2.24
372	300096	易联众	77,991.00	2.24
373	600529	山东药玻	77,665.00	2.23
374	605376	博迁新材	77,454.00	2.22
375	300386	飞天诚信	77,294.00	2.22
376	600057	厦门象屿	77,088.00	2.21
377	603385	惠达卫浴	76,629.00	2.20
378	002969	嘉美包装	76,526.00	2.20
379	300791	仙乐健康	76,112.00	2.19
380	300615	欣天科技	75,871.00	2.18
381	603915	国茂股份	75,814.00	2.18
382	002666	德联集团	75,582.00	2.17
383	002963	豪尔赛	75,512.00	2.17
384	300932	三友联众	75,498.00	2.17
385	600768	宁波富邦	75,077.00	2.16
386	600152	维科技术	74,800.00	2.15
387	300155	安居宝	74,276.00	2.13
388	300862	蓝盾光电	74,222.00	2.13
389	300448	浩云科技	74,016.00	2.13
390	301059	金三江	73,972.00	2.12
391	300565	科信技术	73,776.00	2.12
392	603268	松发股份	73,242.00	2.10
393	002243	力合科创	73,191.00	2.10
394	300511	雪榕生物	72,826.00	2.09
395	002827	高争民爆	72,746.00	2.09
396	600455	博通股份	72,542.00	2.08



397	002623	亚玛顿	71,945.00	2.07
398	000761	本钢板材	71,922.00	2.07
399	300417	南华仪器	71,732.00	2.06
400	300869	康泰医学	71,673.00	2.06
401	603189	网达软件	71,414.00	2.05
402	000635	英力特	71,247.00	2.05
403	603339	四方科技	71,130.00	2.04
404	000921	海信家电	70,822.00	2.03
405	600210	紫江企业	70,412.00	2.02
406	002418	康盛股份	70,334.00	2.02
407	300508	维宏股份	69,830.00	2.01
408	002073	软控股份	69,778.00	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。

#### 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	300097	智云股份	338,746.00	9.73
2	002123	梦网科技	335,053.00	9.62
3	002221	东华能源	330,622.00	9.49
4	300161	华中数控	326,093.00	9.36
5	300212	易华录	301,874.00	8.67
6	300590	移为通信	297,312.00	8.54
7	300657	弘信电子	288,026.00	8.27
8	300731	科创新源	284,575.00	8.17
9	603960	克来机电	243,136.00	6.98
10	300891	惠云钛业	240,179.00	6.90
11	300937	药易购	232,639.00	6.68
12	300222	科大智能	230,745.00	6.63
13	300132	青松股份	229,859.00	6.60
14	300713	英可瑞	220,571.00	6.33
15	300225	金力泰	218,730.00	6.28
16	600110	诺德股份	216,040.00	6.20
17	300818	耐普矿机	215,787.00	6.20
18	300581	晨曦航空	210,457.00	6.04
19	300383	光环新网	209,573.00	6.02

20	300707	威唐工业	209,571.00	6.02
21	300293	蓝英装备	207,721.00	5.97
22	300072	海新能科	207,140.00	5.95
23	002488	金固股份	201,912.00	5.80
24	601311	骆驼股份	201,034.00	5.77
25	603897	长城科技	200,822.00	5.77
26	300077	国民技术	198,775.00	5.71
27	300456	赛微电子	197,272.00	5.67
28	300623	捷捷微电	196,058.00	5.63
29	002824	和胜股份	194,679.00	5.59
30	603160	汇顶科技	194,232.00	5.58
31	300143	盈康生命	193,819.00	5.57
32	300490	华自科技	192,588.00	5.53
33	300055	万邦达	191,964.00	5.51
34	601678	滨化股份	188,170.00	5.40
35	002466	天齐锂业	187,247.00	5.38
36	000811	冰轮环境	186,012.00	5.34
37	300460	惠伦晶体	185,788.00	5.34
38	002802	洪汇新材	184,418.60	5.30
39	000782	美达股份	183,737.00	5.28
40	600223	鲁商发展	181,970.00	5.23
41	300857	协创数据	180,440.00	5.18
42	300757	罗博特科	179,868.00	5.17
43	600114	东睦股份	179,312.00	5.15
44	603048	浙江黎明	176,634.00	5.07
45	605020	永和股份	173,366.00	4.98
46	600338	西藏珠峰	169,836.00	4.88
47	002975	博杰股份	168,308.00	4.83
48	600641	万业企业	162,913.00	4.68
49	300219	鸿利智汇	161,483.00	4.64
50	002165	红宝丽	158,995.00	4.57
51	301051	信濠光电	158,729.00	4.56
52	300226	上海钢联	158,434.80	4.55
53	300943	春晖智控	158,287.50	4.55
54	003029	吉大正元	157,763.00	4.53
55	603186	华正新材	157,030.00	4.51
56	300085	银之杰	156,235.00	4.49
57	300745	欣锐科技	155,702.00	4.47

58	300375	鹏翎股份	154,832.00	4.45
59	002284	亚太股份	150,020.00	4.31
60	300221	银禧科技	149,069.00	4.28
61	300091	金通灵	146,336.00	4.20
62	603093	南华期货	145,931.00	4.19
63	603121	华培动力	145,632.00	4.18
64	603650	彤程新材	144,967.00	4.16
65	300052	中青宝	144,623.00	4.15
66	300655	晶瑞电材	141,967.50	4.08
67	300472	新元科技	140,819.00	4.04
68	002128	电投能源	140,444.00	4.03
69	601519	大智慧	137,908.00	3.96
70	300457	赢合科技	137,829.00	3.96
71	603068	博通集成	135,634.00	3.90
72	300659	中孚信息	135,121.00	3.88
73	603320	迪贝电气	134,579.00	3.86
74	300366	创意信息	133,794.00	3.84
75	002886	沃特股份	133,298.00	3.83
76	600753	东方银星	129,686.00	3.72
77	300620	光库科技	129,453.00	3.72
78	603026	石大胜华	129,244.00	3.71
79	002611	东方精工	128,264.00	3.68
80	300985	致远新能	128,072.00	3.68
81	002281	光迅科技	127,406.00	3.66
82	300228	富瑞特装	126,608.00	3.64
83	300276	三丰智能	125,504.00	3.60
84	300546	雄帝科技	125,124.00	3.59
85	002298	中电兴发	123,777.00	3.55
86	300243	瑞丰高材	122,925.00	3.53
87	000537	广宇发展	122,258.00	3.51
88	300151	昌红科技	120,527.00	3.46
89	603663	三祥新材	118,453.00	3.40
90	600297	广汇汽车	118,250.00	3.40
91	002912	中新赛克	116,949.00	3.36
92	603917	合力科技	116,412.00	3.34
93	300056	中创环保	116,298.00	3.34
94	300193	佳士科技	115,666.00	3.32
95	300688	创业黑马	115,576.00	3.32

96	601137	博威合金	115,135.00	3.31
97	002978	安宁股份	114,210.00	3.28
98	300602	飞荣达	113,730.00	3.27
99	002054	德美化工	113,090.00	3.25
100	300538	同益股份	113,071.00	3.25
101	300241	瑞丰光电	112,544.00	3.23
102	300698	万马科技	111,898.00	3.21
103	601126	四方股份	111,330.00	3.20
104	300543	朗科智能	111,311.00	3.20
105	600363	联创光电	111,131.00	3.19
106	300342	天银机电	110,886.00	3.18
107	300721	怡达股份	110,734.00	3.18
108	002360	同德化工	109,316.00	3.14
109	300650	太龙股份	109,225.00	3.14
110	002436	兴森科技	107,547.00	3.09
111	002792	通宇通讯	107,110.00	3.08
112	300421	力星股份	106,176.00	3.05
113	300582	英飞特	105,949.00	3.04
114	301036	双乐股份	105,433.00	3.03
115	002483	润邦股份	104,753.00	3.01
116	603936	博敏电子	104,523.00	3.00
117	603681	永冠新材	104,416.00	3.00
118	603507	振江股份	103,816.00	2.98
119	301083	百胜智能	103,354.00	2.97
120	300684	中石科技	103,349.00	2.97
121	601339	百隆东方	103,162.00	2.96
122	600399	抚顺特钢	102,943.00	2.96
123	002278	神开股份	102,797.00	2.95
124	002369	卓翼科技	102,575.00	2.95
125	002420	毅昌科技	102,487.00	2.94
126	002825	纳尔股份	102,322.00	2.94
127	300382	斯莱克	102,069.00	2.93
128	002922	伊戈尔	101,822.00	2.92
129	002010	传化智联	100,388.00	2.88
130	002213	大为股份	100,347.00	2.88
131	600011	华能国际	100,316.00	2.88
132	300644	南京聚隆	99,607.00	2.86
133	300473	德尔股份	99,527.00	2.86

134	002790	瑞尔特	98,827.00	2.84
135	002402	和而泰	98,670.00	2.83
136	603776	永安行	98,513.00	2.83
137	600673	东阳光	98,172.00	2.82
138	600493	凤竹纺织	97,958.00	2.81
139	002201	正威新材	97,932.00	2.81
140	300552	万集科技	97,922.00	2.81
141	000996	中国中期	97,664.00	2.80
142	603683	晶华新材	97,502.20	2.80
143	300405	科隆股份	96,763.60	2.78
144	605069	正和生态	96,518.00	2.77
145	002026	山东威达	95,889.00	2.75
146	000831	五矿稀土	95,649.00	2.75
147	603893	瑞芯微	95,628.00	2.75
148	300131	英唐智控	95,547.00	2.74
149	603633	徕木股份	95,527.00	2.74
150	603105	芯能科技	95,505.00	2.74
151	300772	运达股份	95,177.20	2.73
152	000503	国新健康	94,963.00	2.73
153	600386	北巴传媒	94,071.00	2.70
154	603030	全筑股份	94,023.00	2.70
155	002527	新时达	93,911.00	2.70
156	002970	锐明技术	93,898.00	2.70
157	300690	双一科技	93,492.00	2.68
158	002196	方正电机	93,441.00	2.68
159	603725	天安新材	93,139.00	2.67
160	002655	共达电声	92,318.00	2.65
161	600180	瑞茂通	92,262.00	2.65
162	300842	帝科股份	91,948.00	2.64
163	300320	海达股份	91,943.00	2.64
164	600653	申华控股	91,900.00	2.64
165	002892	科力尔	91,823.40	2.64
166	600623	华谊集团	91,740.00	2.63
167	300932	三友联众	91,692.80	2.63
168	300920	润阳科技	91,569.00	2.63
169	300510	金冠股份	91,563.00	2.63
170	000099	中信海直	91,279.00	2.62
171	600330	天通股份	91,114.00	2.62

172	600985	淮北矿业	90,759.00	2.61
173	002375	亚厦股份	90,505.00	2.60
174	002011	盾安环境	90,403.00	2.60
175	600418	江淮汽车	90,308.00	2.59
176	600712	南宁百货	89,345.00	2.57
177	300218	安利股份	88,627.00	2.55
178	002381	双箭股份	88,610.00	2.54
179	000821	京山轻机	88,433.00	2.54
180	002623	亚玛顿	88,421.00	2.54
181	600458	时代新材	88,360.00	2.54
182	600231	凌钢股份	87,982.00	2.53
183	300484	蓝海华腾	87,877.00	2.52
184	603997	继峰股份	87,478.00	2.51
185	300480	光力科技	86,994.92	2.50
186	300827	上能电气	86,960.00	2.50
187	600321	正源股份	86,882.00	2.50
188	002988	豪美新材	86,871.00	2.49
189	300667	必创科技	86,763.00	2.49
190	603915	国茂股份	86,659.00	2.49
191	300769	德方纳米	86,341.00	2.48
192	003022	联泓新科	86,334.00	2.48
193	300195	长荣股份	86,180.00	2.47
194	600111	北方稀土	85,684.00	2.46
195	300791	仙乐健康	85,163.00	2.45
196	002198	嘉应制药	85,075.00	2.44
197	002931	锋龙股份	84,757.00	2.43
198	603738	泰晶科技	84,270.00	2.42
199	300565	科信技术	83,244.00	2.39
200	600362	江西铜业	83,230.00	2.39
201	000959	首钢股份	82,680.00	2.37
202	300465	高伟达	82,416.00	2.37
203	301149	隆华新材	82,240.00	2.36
204	300872	天阳科技	82,046.00	2.36
205	601588	北辰实业	81,880.00	2.35
206	000507	珠海港	81,820.00	2.35
207	600455	博通股份	81,249.00	2.33
208	002280	联络互动	81,129.00	2.33
209	300358	楚天科技	80,618.00	2.32

210	603318	水发燃气	80,015.00	2.30
211	300563	神宇股份	79,952.00	2.30
212	002431	棕榈股份	79,864.00	2.29
213	603990	麦迪科技	79,029.00	2.27
214	300545	联得装备	78,945.00	2.27
215	002969	嘉美包装	78,860.00	2.26
216	300386	飞天诚信	78,763.00	2.26
217	301059	金三江	78,507.00	2.25
218	002243	力合科创	77,936.00	2.24
219	605376	博迁新材	77,257.00	2.22
220	600152	维科技术	77,140.00	2.22
221	300368	汇金股份	76,665.00	2.20
222	600079	人福医药	76,596.00	2.20
223	300708	聚灿光电	75,985.00	2.18
224	300162	雷曼光电	75,973.00	2.18
225	300508	维宏股份	75,855.00	2.18
226	603518	锦泓集团	75,693.00	2.17
227	300127	银河磁体	75,604.00	2.17
228	002666	德联集团	75,489.00	2.17
229	002520	日发精机	74,750.00	2.15
230	002780	三夫户外	74,548.00	2.14
231	300807	天迈科技	74,281.00	2.13
232	300236	上海新阳	74,106.00	2.13
233	000921	海信家电	73,804.00	2.12
234	000920	沃顿科技	73,500.00	2.11
235	600774	汉商集团	73,500.00	2.11
236	300987	川网传媒	73,333.00	2.11
237	603516	淳中科技	72,705.00	2.09
238	603727	博迈科	72,538.00	2.08
239	600057	厦门象屿	72,491.00	2.08
240	300869	康泰医学	72,411.00	2.08
241	000423	东阿阿胶	72,339.00	2.08
242	600282	南钢股份	72,192.00	2.07
243	600433	冠豪高新	72,083.00	2.07
244	605196	华通线缆	71,693.00	2.06
245	000691	亚太实业	71,597.00	2.06
246	002073	软控股份	71,593.00	2.06
247	002967	广电计量	71,046.00	2.04

248	603069	海汽集团	70,950.00	2.04
249	002289	宇顺电子	70,885.00	2.04
250	600429	三元股份	70,422.00	2.02
251	000677	恒天海龙	69,941.00	2.01
252	300300	海峡创新	69,756.00	2.00
253	000635	英力特	69,754.00	2.00
254	000906	浙商中拓	69,748.00	2.00
255	000761	本钢板材	69,649.00	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。

### 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	84,528,186.37
卖出股票收入（成交）总额	55,912,204.01

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。

### 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未投资股指期货。

### 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 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，北京华力创通科技股份有限公司于 2021 年 7 月 20 日受到北京海淀税务局给予罚款 20 万元的行政处罚；广州航新航空科技股份有限公司与 2021 年 12 月 31 日收到中国证监会广东监管局给予警示函的处分决定；与 2022 年 3 月 2 日收到深圳证券交易所给予监管关注的处分决定。

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，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。

### 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	5,420.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,689,872.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,695,293.10

### 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
14,919	1,586.62	498,411.14	2.11%	23,172,429.83	97.89%

### 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	172,819.63	0.7301%

### 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	0~10

## § 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	2,120,105.71
本报告期基金总申购份额	27,973,374.44
减：本报告期基金总赎回份额	6,422,639.18
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	23,670,840.97

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

本基金管理人董事会于 2021 年 12 月 13 日审议通过了《关于批准国金基金管理有限公司原任董事、总经理尹庆军先生辞职的议案》、《关于董事长纪路先生提名邵海波先生担任国金基金管理有限公司总经理的议案》等议案，邵海波先生自 2022 年 1 月 28 日起担任公司总经理职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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	103,803,039.84	73.91%	44,771.18	73.91%	-
招商证券	2	36,637,350.54	26.09%	15,802.79	26.09%	-

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	-	-	40,700,000.00	100.00%	-	-

### 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 2021 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 21 日
2	《国金基金管理有限公司关于开展直销柜台申购费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 29 日
3	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 29 日
4	《国金量化多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	2022 年 3 月 23 日
5	《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	2022 年 3 月 23 日
6	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 30 日

7	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 22 日
8	《关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 23 日
9	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 30 日
10	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 5 月 28 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。

## § 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

2022 年 8 月 30 日