

国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
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	82
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	82

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	82
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	82
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
7.12 投资组合报告附注	83
§ 8 基金份额持有人信息	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
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情况	84
§ 9 开放式基金份额变动	84
§ 10 重大事件揭示	85
10.1 基金份额持有人大会决议	85
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	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
10.4 基金投资策略的改变	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
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	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
10.8 其他重大事件	89
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	90
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	90
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	90
§ 12 备查文件目录	90
12.1 备查文件目录	90
12.2 存放地点	91
12.3 查阅方式	91

§ 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	
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	3,002,791,811.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
下属分级基金的交易代码	006195	016858
报告期末下属分级基金的份额总额	1,982,884,749.28 份	1,019,907,062.49 份

注：我司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定自 2022 年 10 月 14 日起对国金量化多因子股票型证券投资基金增设 C 类基金份额类别（基金代码：016858），并对《基金合同》作相应修改。

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	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。

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	张静	许俊
	联系电话	010-88005695	010-66596688
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

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
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	
本期已实现收益	237,292,616.58	111,940,825.46	
本期利润	257,016,586.99	107,146,532.09	
加权平均基金份额本期利润	0.1648	0.1383	
本期加权平均净值利润率	8.17%	6.86%	
本期基金份额净值增长率	12.65%	12.43%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利润	2,134,149,294.92	1,051,629,162.86
	期末可供分配基金份额利润	1.0763	1.0311
	期末基金资产净值	4,117,034,044.20	2,112,214,015.16
	期末基金份额净值	2.0763	2.0710

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	107.63%	19.19%

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

国金量化多因子 A

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	2.86%	0.91%	-0.60%	0.79%	3.46%	0.12%
过去三个月	1.60%	0.85%	-4.29%	0.70%	5.89%	0.15%
过去六个月	12.65%	0.79%	2.44%	0.67%	10.21%	0.12%
过去一年	16.26%	1.00%	-5.26%	0.81%	21.52%	0.19%
过去三年	82.16%	1.16%	4.55%	1.01%	77.61%	0.15%
自基金合同生效起至今	107.63%	1.17%	41.58%	1.13%	66.05%	0.04%

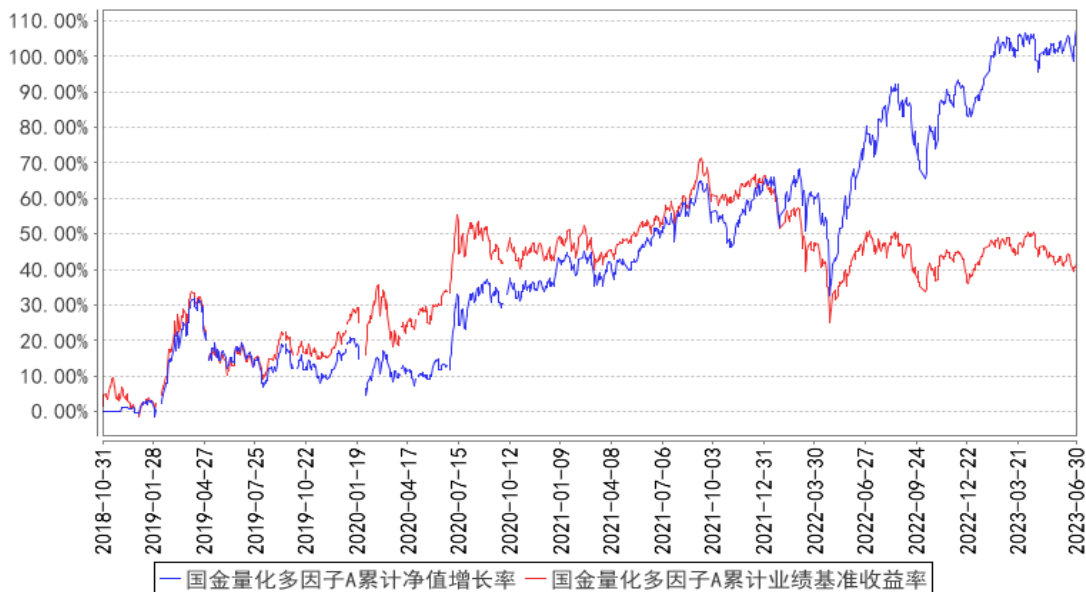
国金量化多因子 C

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	2.83%	0.91%	-0.60%	0.79%	3.43%	0.12%
过去三个月	1.49%	0.85%	-4.29%	0.70%	5.78%	0.15%
过去六个月	12.43%	0.79%	2.44%	0.67%	9.99%	0.12%
自基金合同生效起至今	19.19%	0.86%	2.93%	0.73%	16.26%	0.13%

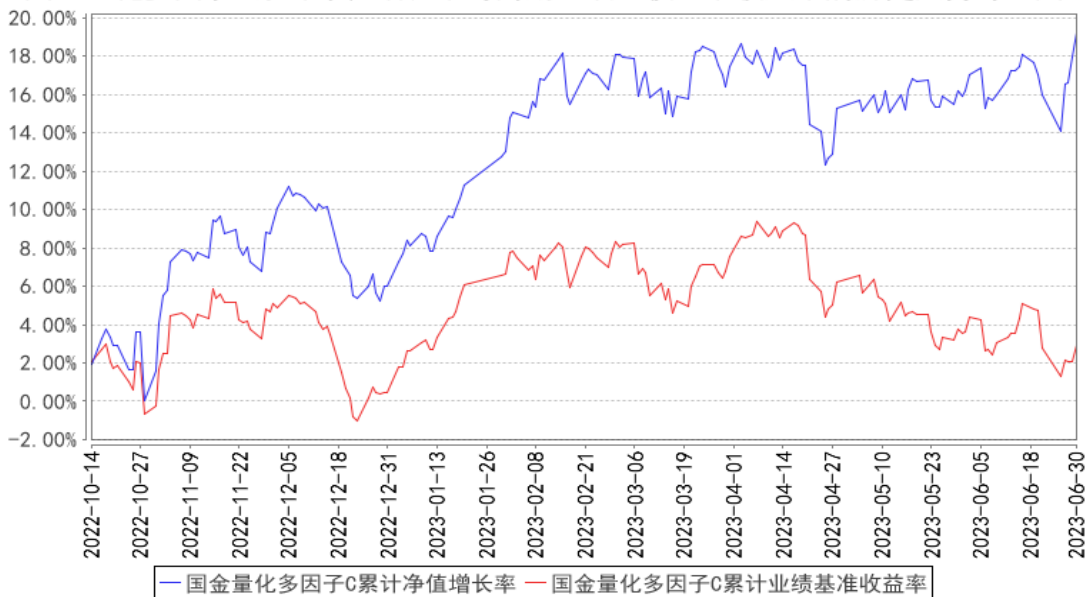
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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A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



国金量化多因子C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 A 类合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，图示日期为 2018 年 10 月 31 日至 2023 年 6 月 30 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2022 年 10 月 14 日，图示日期为 2022 年 10 月 14 日至 2023 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51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至2023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，国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金，国金惠远纯债债券型证券投资基金，国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金，国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金，国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金，国金自主创新混合型证券投资基金，国金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，国金新兴价值混合型证券投资基金，国金量化精选混合型证券投资基金，国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金，国金中证1000指数增强型证券投资基金，国金中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金，国金中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2020年9月3日	-	7年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003年7月至2016年5月历任华泰贝通网络科技有限公司担任IT事业部测试工程师，奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理，2016年5月加入国金基

					金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资事业部副总经理。
姚加红	本基金的基金经理	2023 年 1 月 5 日	-	19 年	姚加红先生，北京航空航天大学硕士。2004 年 4 月至 2011 年 5 月在博时基金管理有限公司任信息技术部高级程序员。2011 年 6 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部总经理、指数投资事业部副总经理等职务，现任国金基金管理有限公司量化投资事业部总经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
姚加红	公募基金	2	8,313,429,535.78	2023 年 1 月 5 日
	私募资产管理计划	6	1,179,084,159.05	2016 年 4 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	9,492,513,694.83	-

注：截至本报告期末，马芳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，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

市场环境方面，上半年整体看既有趋势明显、波动较大的人工智能、计算机、传媒和通信等主题或者行业赛道，也有机会分散、相对均衡的结构化机会；风格和赛道的切换相对频繁，整体市场活跃度较好，但市场波动大部分处于历史相对较低位置。基本面因子层面：市值方面大小票风格交替占优；动量今年三月底以来至报告期末该风险因子收益上涨趋势明显；盈利率风格今年以来趋势明显，延续性较强。报告期内行业涨跌幅方面，通信、传媒和计算机等行业区间涨幅较大；消费者服务、房地产和综合等行业跌幅较大。国金量化多因子业绩比较基准是中证 500 指数收益，投资目标是获取相对稳健的超额收益。产品报告期内持续高仓位运作，持仓分散度高，上半年超额收益特征相对稳健，主要源于收益来源的多样化和分散的持仓风格。国金量化策略模型是基于机器学习技术框架构建的，使用财务基本面和情绪面等数据，模型通过不断适应市场环境，目标是获取相对持续和稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 2.0763 元，累计单位净值为 2.0763 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 12.65%，同期业绩比较基准增长率为 2.44%。

本基金 C 类份额单位净值为 2.0710 元，累计单位净值为 2.0710 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 12.43%，同期业绩比较基准增长率为 2.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预期市场风格和赛道相对频繁切换在一定时间范围内仍将是主要旋律；市场波动持续较低水平的概率仍较大。

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

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、

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

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

4.7 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，不存在应分配而未分配的情况。

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	387,040,411.65	223,205,008.38
结算备付金		64,068,976.30	13,397,948.95
存出保证金		2,957,942.82	679,289.71
交易性金融资产	6.4.7.2	5,684,163,527.94	1,799,016,672.88
其中：股票投资		5,684,163,527.94	1,799,016,672.88
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	178,061,720.65	244,680,403.80
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		-	63,200,104.24
应收股利		-	-
应收申购款		50,003,321.98	6,448,533.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,366,295,901.34	2,350,627,961.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		37,091,369.51	128,555,564.37
应付赎回款		81,370,375.79	19,102,384.33
应付管理人报酬		7,385,132.76	2,397,492.42
应付托管费		984,684.38	319,665.66
应付销售服务费		674,729.43	179,146.81
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	9,541,550.11	2,122,567.77
负债合计		137,047,841.98	152,676,821.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,002,791,811.77	1,192,692,240.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,226,456,247.59	1,005,258,899.66
净资产合计		6,229,248,059.36	2,197,951,140.15
负债和净资产总计		6,366,295,901.34	2,350,627,961.51

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，国金量化多因子 A 基金份额净值 2.0763 元，基金份额总额 1,982,884,749.28 份；国金量化多因子 C 基金份额净值 2.0710 元，基金份额总额 1,019,907,062.49 份。国金量化多因子份额总额合计为 3,002,791,811.77 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		406,416,885.19	2,531,776.93
1. 利息收入		4,053,416.34	6,152.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,032,429.06	2,764.32
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		3,020,987.28	3,388.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		378,486,068.49	1,441,905.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	331,072,391.79	1,381,339.49
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	6.4.7.16	-	-
收益			
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	47,413,676.70	60,546.71
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	14,929,677.04	1,023,373.83
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	8,947,723.32	60,345.56
减：二、营业总支出		42,253,766.11	104,318.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	34,482,353.95	67,956.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,597,647.16	9,060.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,037,461.29	-
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	136,303.71	27,300.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		364,163,119.08	2,427,458.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		364,163,119.08	2,427,458.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		364,163,119.08	2,427,458.69

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：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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)	1,192,692,240. 49	-	1,005,258,899. 66	2,197,951,140.1 5
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)	1,192,692,240. 49	-	1,005,258,899. 66	2,197,951,140.1 5
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,810,099,571. 28	-	2,221,197,347. 93	4,031,296,919.2 1
(一)、综合收益总额	-	-	364,163,119.08	364,163,119.08
(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)	1,810,099,571. 28	-	1,857,034,228. 85	3,667,133,800.1 3
其中：1. 基金申购款	3,504,505,738. 35	-	3,581,397,763. 92	7,085,903,502.2 7
2. 基金赎回款	-1,694,406,167. .07	-	-1,724,363,535. .07	-3,418,769,702. 14
(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)	3,002,791,811. 77	-	3,226,456,247. 59	6,229,248,059.3 6
项目	上年度可比期间 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

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（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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于2022年10月14日增设C类基金份额类别，本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	387,040,411.65
等于：本金	387,002,985.95
加：应计利息	37,425.70
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	387,040,411.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,732,783,292.13	-	5,684,163,527.94	-48,619,764.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,732,783,292.13	-	5,684,163,527.94	-48,619,764.19

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 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	178,061,720.65	-
银行间市场	-	-
合计	178,061,720.65	-

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,353.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,365,058.57
其中：交易所市场	9,365,058.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	154,138.35
合计	9,541,550.11

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化多因子 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	853,060,173.35	853,060,173.35
本期申购	2,058,485,578.14	2,058,485,578.14
本期赎回（以“-”号填列）	-928,661,002.21	-928,661,002.21
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,982,884,749.28	1,982,884,749.28

国金量化多因子 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	339,632,067.14	339,632,067.14
本期申购	1,446,020,160.21	1,446,020,160.21
本期赎回（以“-”号填列）	-765,745,164.86	-765,745,164.86
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,019,907,062.49	1,019,907,062.49

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。

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

国金量化多因子 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	783,108,623.53	-63,832,401.20	719,276,222.33
本期利润	237,292,616.58	19,723,970.41	257,016,586.99
本期基金份额交易产生的变动数	1,118,660,537.74	39,195,947.86	1,157,856,485.60
其中：基金申购款	2,059,178,988.99	41,927,782.13	2,101,106,771.12
基金赎回款	-940,518,451.25	-2,731,834.27	-943,250,285.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,139,061,777.85	-4,912,482.93	2,134,149,294.92

国金量化多因子 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	296,993,929.13	-11,011,251.80	285,982,677.33
本期利润	111,940,825.46	-4,794,293.37	107,146,532.09
本期基金份额交易产生	642,694,408.27	56,483,334.98	699,177,743.25

的变动数			
其中：基金申购款	1,395,589,514.25	84,701,478.55	1,480,290,992.80
基金赎回款	-752,895,105.98	-28,218,143.57	-781,113,249.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,051,629,162.86	40,677,789.81	1,092,306,952.67

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	654,982.75
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	360,610.03
其他	16,836.28
合计	1,032,429.06

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	331,072,391.79
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	331,072,391.79

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	14,958,268,346.42
减：卖出股票成本总额	14,595,192,831.59
减：交易费用	32,003,123.04
买卖股票差价收入	331,072,391.79

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

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

注：无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	47,413,676.70
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	47,413,676.70

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	14,929,677.04
股票投资	14,929,677.04
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	14,929,677.04

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	8,572,939.35
基金转换费收入	374,783.97
合计	8,947,723.32

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行费用	32,165.36
合计	136,303.71

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

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	34,482,353.95	67,956.91
其中：支付销售机构的客户维护费	10,368,540.03	27,128.50

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,597,647.16	9,060.90

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期

名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
国金基金管理有限公司	-	932,854.26	932,854.26
国金证券股份有限公司	-	172,056.78	172,056.78
合计	-	1,104,911.04	1,104,911.04
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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-活期存款	387,040,411.65	654,982.75	7,162,521.23	1,959.81

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（2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301376	致欧科	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

	技	日								
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,794	67,956.72	52,905.06	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.10	1,118,900	8,030,626.01	7,798,733.00	-
000691	亚太实业	2023年7月3日	重大事项停牌	4.36	2023年7月4日	4.80	943,300	4,821,050.69	4,112,788.00	-
600530	交大昂立	2023年5月4日	重大事项停牌	2.49	2023年7月5日	2.37	177,300	718,688.84	441,477.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：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 2023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	387,040,411.65	-	-	-	-	-	387,040,411.65
结算备付金	64,068,976.30	-	-	-	-	-	64,068,976.30
存出保证金	2,957,942.82	-	-	-	-	-	2,957,942.82
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,684,163,527.94	5,684,163,527.94
买入返售金融资产	178,061,720.65	-	-	-	-	-	178,061,720.65

应收申购款	-	-	-	-	-	50,003,321.98	50,003,321.98
资产总计	632,129,051.42	-	-	-	-	-5,734,166,849.92	6,366,295,901.34
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	37,091,369.51	37,091,369.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	81,370,375.79	81,370,375.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,385,132.76	7,385,132.76
应付托管费	-	-	-	-	-	984,684.38	984,684.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	674,729.43	674,729.43
其他负债	-	-	-	-	-	9,541,550.11	9,541,550.11
负债总计	-	-	-	-	-	137,047,841.98	137,047,841.98
利率敏感度缺口	632,129,051.42	-	-	-	-	-5,597,119,007.94	6,229,248,059.36
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	223,205,008.38	-	-	-	-	-	223,205,008.38
结算备付金	13,397,948.95	-	-	-	-	-	13,397,948.95
存出保证金	679,289.71	-	-	-	-	-	679,289.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,799,016,672.88	1,799,016,672.88
买入返售金融资产	244,680,403.80	-	-	-	-	-	244,680,403.80
应收申购款	-	-	-	-	-	6,448,533.55	6,448,533.55
应收清算款	-	-	-	-	-	63,200,104.24	63,200,104.24
资产总计	481,962,650.84	-	-	-	-	-1,868,665,310.67	2,350,627,961.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,102,384.33	19,102,384.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,397,492.42	2,397,492.42
应付托管费	-	-	-	-	-	319,665.66	319,665.66
应付清算款	-	-	-	-	-	128,555,564.37	128,555,564.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	179,146.81	179,146.81
其他负债	-	-	-	-	-	2,122,567.77	2,122,567.77
负债总计	-	-	-	-	-	152,676,821.36	152,676,821.36
利率敏感度缺口	481,962,650.84	-	-	-	-	-1,715,988,489.31	2,197,951,140.15

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：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 2023年6月30日		上年度末 2022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	5,684,163,527.94	91.25	1,799,016,672.88	81.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	5,684,163,527.94	91.25	1,799,016,672.88	81.85

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	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	+5%	275,094,553.53	100,885,721.14
	-5%	-275,094,553.53	-100,885,721.14

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。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	5,671,441,787.99	1,798,281,408.88
第二层次	12,352,998.00	735,264.00
第三层次	368,741.95	-
合计	5,684,163,527.94	1,799,016,672.88

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。

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	5,684,163,527.94	89.29
	其中：股票	5,684,163,527.94	89.29
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	178,061,720.65	2.80
	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	451,109,387.95	7.09
8	其他各项资产	52,961,264.80	0.83
9	合计	6,366,295,901.34	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	11,490,350.00	0.18
B	采矿业	105,476,981.00	1.69
C	制造业	3,590,174,007.83	57.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,115,783.75	1.24
E	建筑业	210,112,733.24	3.37
F	批发和零售业	161,621,044.93	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业	287,104,061.06	4.61

H	住宿和餐饮业	1,148,148.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	422,462,433.55	6.78
J	金融业	330,087,280.02	5.30
K	房地产业	106,522,143.96	1.71
L	租赁和商务服务业	90,628,477.55	1.45
M	科学研究和技术服务业	89,130,732.63	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	61,870,366.27	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,060,915.00	0.37
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	97,569,954.00	1.57
S	综合	18,564,332.29	0.30
	合计	5,684,163,527.94	91.25

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601618	中国中冶	8,938,100	35,484,257.00	0.57
2	000778	新兴铸管	5,397,400	22,021,392.00	0.35
3	000987	越秀资本	3,463,262	21,991,713.70	0.35
4	600339	中油工程	5,362,900	21,827,003.00	0.35
5	600028	中国石化	3,413,500	21,709,860.00	0.35
6	601108	财通证券	2,839,900	20,560,876.00	0.33
7	600125	铁龙物流	3,352,200	20,247,288.00	0.33
8	600531	豫光金铅	2,747,300	17,307,990.00	0.28
9	601000	唐山港	4,877,750	17,218,457.50	0.28
10	000563	陕国投 A	5,311,600	16,200,380.00	0.26
11	000783	长江证券	2,647,800	15,357,240.00	0.25
12	300098	高新兴	4,193,500	15,306,275.00	0.25
13	000582	北部湾港	1,946,095	14,790,322.00	0.24
14	600377	宁沪高速	1,476,500	14,513,995.00	0.23
15	002421	达实智能	4,098,819	14,427,842.88	0.23
16	600320	振华重工	3,853,000	14,371,690.00	0.23
17	600170	上海建工	5,295,500	14,244,895.00	0.23
18	600420	国药现代	1,210,086	13,661,870.94	0.22
19	600017	日照港	4,568,000	13,658,320.00	0.22
20	000836	富通信息	4,581,900	13,654,062.00	0.22
21	600820	隧道股份	2,254,480	13,549,424.80	0.22
22	000338	潍柴动力	1,086,800	13,541,528.00	0.22

23	300033	同花顺	75,000	13,146,000.00	0.21
24	000793	华闻集团	6,084,300	13,081,245.00	0.21
25	600035	楚天高速	3,198,500	13,049,880.00	0.21
26	603556	海兴电力	514,120	12,976,388.80	0.21
27	002121	科陆电子	1,765,600	12,941,848.00	0.21
28	300398	飞凯材料	747,700	12,852,963.00	0.21
29	300884	狄耐克	963,500	12,756,740.00	0.20
30	600717	天津港	2,850,454	12,627,511.22	0.20
31	002465	海格通信	1,190,100	12,305,634.00	0.20
32	601668	中国建筑	2,140,749	12,287,899.26	0.20
33	002449	国星光电	1,376,900	12,240,641.00	0.20
34	002583	海能达	2,095,900	12,177,179.00	0.20
35	603042	华脉科技	482,400	12,137,184.00	0.19
36	601688	华泰证券	865,700	11,920,689.00	0.19
37	300762	上海瀚讯	1,003,900	11,815,903.00	0.19
38	002275	桂林三金	654,200	11,782,142.00	0.19
39	300597	吉大通信	1,166,900	11,563,979.00	0.19
40	002020	京新药业	901,200	11,553,384.00	0.19
41	603328	依顿电子	1,394,108	11,543,214.24	0.19
42	000901	航天科技	1,074,400	11,496,080.00	0.18
43	002073	软控股份	1,722,600	11,403,612.00	0.18
44	601929	吉视传媒	6,152,100	11,319,864.00	0.18
45	600658	电子城	2,041,140	11,287,504.20	0.18
46	600022	山东钢铁	7,913,800	11,237,596.00	0.18
47	600285	羚锐制药	699,600	11,235,576.00	0.18
48	002237	恒邦股份	1,030,237	11,219,280.93	0.18
49	300131	英唐智控	2,109,000	11,072,250.00	0.18
50	300074	华平股份	2,552,700	11,002,137.00	0.18
51	300041	回天新材	928,090	10,951,462.00	0.18
52	002152	广电运通	933,100	10,935,932.00	0.18
53	300420	五洋停车	3,316,600	10,878,448.00	0.17
54	601319	中国人保	1,861,100	10,868,824.00	0.17
55	603126	中材节能	1,403,200	10,860,768.00	0.17
56	603017	中衡设计	987,600	10,754,964.00	0.17
57	002344	海宁皮城	2,271,100	10,742,303.00	0.17
58	601611	中国核建	1,264,300	10,683,335.00	0.17
59	601318	中国平安	228,800	10,616,320.00	0.17
60	300333	兆日科技	1,586,700	10,519,821.00	0.17
61	002106	莱宝高科	1,234,400	10,492,400.00	0.17
62	002085	万丰奥威	1,500,800	10,400,544.00	0.17
63	002273	水晶光电	866,991	10,351,872.54	0.17
64	001872	招商港口	598,800	10,341,276.00	0.17
65	002345	潮宏基	1,309,200	10,290,312.00	0.17

66	600390	五矿资本	1,898,600	10,214,468.00	0.16
67	300227	光韵达	1,274,300	10,156,171.00	0.16
68	600368	五洲交通	2,776,970	10,108,170.80	0.16
69	002131	利欧股份	4,368,200	10,046,860.00	0.16
70	300445	康斯特	630,100	9,987,085.00	0.16
71	002635	安洁科技	722,000	9,963,600.00	0.16
72	300050	世纪鼎利	2,282,000	9,926,700.00	0.16
73	300414	中光防雷	1,002,300	9,922,770.00	0.16
74	603626	科森科技	1,400,300	9,830,106.00	0.16
75	600360	华微电子	1,423,900	9,796,432.00	0.16
76	002422	科伦药业	330,000	9,794,400.00	0.16
77	300279	和晶科技	1,747,700	9,769,643.00	0.16
78	600639	浦东金桥	782,016	9,704,818.56	0.16
79	600229	城市传媒	1,119,800	9,540,696.00	0.15
80	000973	佛塑科技	2,123,800	9,472,148.00	0.15
81	300242	佳云科技	2,738,700	9,448,515.00	0.15
82	300259	新天科技	2,350,180	9,424,221.80	0.15
83	300241	瑞丰光电	1,880,000	9,418,800.00	0.15
84	300440	运达科技	1,330,100	9,403,807.00	0.15
85	300300	海峡创新	2,177,600	9,341,904.00	0.15
86	300043	星辉娱乐	2,502,400	9,333,952.00	0.15
87	300739	明阳电路	625,620	9,315,481.80	0.15
88	000551	创元科技	838,200	9,312,402.00	0.15
89	300531	优博讯	657,900	9,302,706.00	0.15
90	603012	创力集团	1,505,200	9,287,084.00	0.15
91	002250	联化科技	881,937	9,225,061.02	0.15
92	002154	报喜鸟	1,670,700	9,222,264.00	0.15
93	300099	精准信息	1,447,703	9,207,391.08	0.15
94	603339	四方科技	577,300	9,184,843.00	0.15
95	603998	方盛制药	727,700	9,176,297.00	0.15
96	600572	康恩贝	1,338,800	9,170,780.00	0.15
97	002947	恒铭达	437,800	9,123,752.00	0.15
98	601616	广电电气	2,673,601	9,036,771.38	0.15
99	300377	赢时胜	1,106,800	8,965,080.00	0.14
100	603158	腾龙股份	1,168,200	8,948,412.00	0.14
101	600061	国投资本	1,249,000	8,892,880.00	0.14
102	600073	上海梅林	1,215,500	8,873,150.00	0.14
103	002782	可立克	577,500	8,829,975.00	0.14
104	300035	中科电气	733,500	8,816,670.00	0.14
105	002815	崇达技术	703,300	8,756,085.00	0.14
106	601658	邮储银行	1,787,571	8,741,222.19	0.14
107	300177	中海达	1,286,100	8,706,897.00	0.14
108	000417	合肥百货	1,860,300	8,706,204.00	0.14

109	300269	联建光电	2,564,300	8,692,977.00	0.14
110	600235	民丰特纸	1,587,900	8,606,418.00	0.14
111	300162	雷曼光电	1,222,300	8,580,546.00	0.14
112	600831	广电网络	1,428,000	8,568,000.00	0.14
113	002767	先锋电子	607,900	8,492,363.00	0.14
114	002391	长青股份	1,229,250	8,444,947.50	0.14
115	601198	东兴证券	1,049,300	8,415,386.00	0.14
116	603183	建研院	1,780,500	8,403,960.00	0.13
117	002134	天津普林	818,700	8,383,488.00	0.13
118	300016	北陆药业	1,255,600	8,337,184.00	0.13
119	300689	澄天伟业	356,600	8,333,742.00	0.13
120	002376	新北洋	1,028,900	8,303,223.00	0.13
121	000589	贵州轮胎	1,481,300	8,295,280.00	0.13
122	002863	今飞凯达	1,325,066	8,268,411.84	0.13
123	603686	福龙马	792,540	8,266,192.20	0.13
124	002298	中电兴发	1,214,898	8,261,306.40	0.13
125	300195	长荣股份	1,314,100	8,252,548.00	0.13
126	600284	浦东建设	1,347,800	8,248,536.00	0.13
127	300375	鹏翎股份	2,136,412	8,225,186.20	0.13
128	002697	红旗连锁	1,406,500	8,213,960.00	0.13
129	000627	天茂集团	2,726,600	8,179,800.00	0.13
130	603937	丽岛新材	703,900	8,158,201.00	0.13
131	002301	齐心集团	1,132,800	8,144,832.00	0.13
132	002161	远望谷	1,563,000	8,143,230.00	0.13
133	300194	福安药业	2,093,900	8,124,332.00	0.13
134	000570	苏常柴A	1,456,200	8,111,034.00	0.13
135	002295	精艺股份	1,179,800	8,105,226.00	0.13
136	300277	海联讯	1,026,300	8,046,192.00	0.13
137	002296	辉煌科技	933,300	8,026,380.00	0.13
138	300909	汇创达	303,100	8,007,902.00	0.13
139	002270	华明装备	730,100	7,994,595.00	0.13
140	000900	现代投资	1,977,049	7,967,507.47	0.13
141	300200	高盟新材	933,000	7,939,830.00	0.13
142	000880	潍柴重机	685,600	7,918,680.00	0.13
143	300265	通光线缆	762,000	7,909,560.00	0.13
144	300213	佳讯飞鸿	1,184,000	7,897,280.00	0.13
145	300626	华瑞股份	759,100	7,871,867.00	0.13
146	603687	大胜达	921,800	7,853,736.00	0.13
147	601718	际华集团	2,634,700	7,825,059.00	0.13
148	603628	清源股份	493,900	7,818,437.00	0.13
149	601298	青岛港	1,118,900	7,798,733.00	0.13
150	300281	金明精机	1,453,800	7,792,368.00	0.13
151	002500	山西证券	1,392,700	7,771,266.00	0.12

152	600571	信雅达	849,500	7,764,430.00	0.12
153	300337	银邦股份	1,163,700	7,761,879.00	0.12
154	002593	日上集团	1,997,800	7,731,486.00	0.12
155	002842	翔鹭钨业	906,100	7,729,033.00	0.12
156	002413	雷科防务	1,476,500	7,722,095.00	0.12
157	300219	鸿利智汇	1,050,300	7,719,705.00	0.12
158	002035	华帝股份	1,087,200	7,719,120.00	0.12
159	600130	波导股份	1,771,500	7,706,025.00	0.12
160	300838	浙江力诺	421,000	7,691,670.00	0.12
161	002139	拓邦股份	586,800	7,657,740.00	0.12
162	300419	浩丰科技	1,222,500	7,652,850.00	0.12
163	002861	瀛通通讯	666,980	7,630,251.20	0.12
164	002598	山东章鼓	641,500	7,588,945.00	0.12
165	300283	温州宏丰	1,284,600	7,579,140.00	0.12
166	002133	广宇集团	2,231,900	7,566,141.00	0.12
167	600850	电科数字	320,600	7,562,954.00	0.12
168	002600	领益智造	1,094,400	7,562,304.00	0.12
169	600114	东睦股份	990,000	7,543,800.00	0.12
170	002148	北纬科技	1,234,900	7,532,890.00	0.12
171	300380	安硕信息	405,800	7,507,300.00	0.12
172	600184	光电股份	570,700	7,493,291.00	0.12
173	603266	天龙股份	538,400	7,489,144.00	0.12
174	002809	红墙股份	691,900	7,472,520.00	0.12
175	300698	万马科技	262,800	7,460,892.00	0.12
176	300415	伊之密	388,400	7,457,280.00	0.12
177	600999	招商证券	549,200	7,452,644.00	0.12
178	605258	协和电子	286,800	7,451,064.00	0.12
179	600060	海信视像	300,500	7,437,375.00	0.12
180	002869	金溢科技	337,400	7,416,052.00	0.12
181	002730	电光科技	773,400	7,409,172.00	0.12
182	600704	物产中大	1,498,900	7,404,566.00	0.12
183	300154	瑞凌股份	919,500	7,365,195.00	0.12
184	300322	硕贝德	867,900	7,342,434.00	0.12
185	600909	华安证券	1,566,500	7,315,555.00	0.12
186	600582	天地科技	1,250,800	7,292,164.00	0.12
187	002926	华西证券	877,029	7,288,110.99	0.12
188	605058	澳弘电子	323,900	7,271,555.00	0.12
189	002563	森马服饰	1,167,600	7,262,472.00	0.12
190	002119	康强电子	559,056	7,250,956.32	0.12
191	002952	亚世光电	408,500	7,242,705.00	0.12
192	601998	中信银行	1,211,100	7,242,378.00	0.12
193	000898	鞍钢股份	2,596,800	7,219,104.00	0.12
194	603700	宁水集团	492,500	7,200,350.00	0.12

195	002302	西部建设	1,007,400	7,192,836.00	0.12
196	000623	吉林敖东	446,900	7,168,276.00	0.12
197	600309	万华化学	81,300	7,141,392.00	0.11
198	603367	辰欣药业	470,200	7,137,636.00	0.11
199	603729	龙韵股份	477,600	7,130,568.00	0.11
200	002231	奥维通信	1,019,100	7,123,509.00	0.11
201	002955	鸿合科技	302,340	7,120,107.00	0.11
202	002655	共达电声	547,700	7,114,623.00	0.11
203	300184	力源信息	1,410,400	7,080,208.00	0.11
204	300472	新元科技	654,900	7,053,273.00	0.11
205	300543	朗科智能	712,700	7,048,603.00	0.11
206	000750	国海证券	2,102,300	7,042,705.00	0.11
207	300835	龙磁科技	224,400	7,041,672.00	0.11
208	002367	康力电梯	770,900	7,038,317.00	0.11
209	603637	镇海股份	852,800	7,035,600.00	0.11
210	600968	海油发展	2,288,700	7,026,309.00	0.11
211	003019	宸展光电	342,710	7,025,555.00	0.11
212	601898	中煤能源	829,400	7,000,136.00	0.11
213	601600	中国铝业	1,271,200	6,978,888.00	0.11
214	300251	光线传媒	859,800	6,955,782.00	0.11
215	300193	佳士科技	908,000	6,937,120.00	0.11
216	600551	时代出版	627,500	6,933,875.00	0.11
217	600525	长园集团	1,178,400	6,928,992.00	0.11
218	300936	中英科技	204,600	6,903,204.00	0.11
219	600643	爱建集团	1,375,300	6,876,500.00	0.11
220	600369	西南证券	1,881,300	6,866,745.00	0.11
221	300319	麦捷科技	800,800	6,854,848.00	0.11
222	300107	建新股份	1,399,000	6,841,110.00	0.11
223	600288	大恒科技	564,900	6,818,343.00	0.11
224	002303	美盈森	2,109,200	6,812,716.00	0.11
225	605167	利柏特	702,800	6,803,104.00	0.11
226	000823	超声电子	715,400	6,781,992.00	0.11
227	603377	东方时尚	842,300	6,772,092.00	0.11
228	300647	超频三	939,000	6,742,020.00	0.11
229	300123	亚光科技	924,245	6,728,503.60	0.11
230	603167	渤海轮渡	947,600	6,727,960.00	0.11
231	002181	粤传媒	1,358,300	6,710,002.00	0.11
232	300462	华铭智能	571,100	6,704,714.00	0.11
233	300433	蓝思科技	569,400	6,696,144.00	0.11
234	603917	合力科技	284,700	6,684,756.00	0.11
235	002943	宇晶股份	209,470	6,682,093.00	0.11
236	600020	中原高速	1,820,300	6,680,501.00	0.11
237	600232	金鹰股份	1,218,700	6,654,102.00	0.11

238	002966	苏州银行	1,013,450	6,638,097.50	0.11
239	600830	香溢融通	1,083,000	6,617,130.00	0.11
240	300805	电声股份	791,900	6,612,365.00	0.11
241	600583	海油工程	1,128,300	6,600,555.00	0.11
242	300076	GQY 视讯	1,293,000	6,594,300.00	0.11
243	300889	爱克股份	440,000	6,586,800.00	0.11
244	002662	京威股份	1,969,500	6,558,435.00	0.11
245	603528	多伦科技	857,130	6,548,473.20	0.11
246	000967	盈峰环境	1,292,700	6,528,135.00	0.10
247	600787	中储股份	1,210,718	6,525,770.02	0.10
248	600720	祁连山	573,100	6,516,147.00	0.10
249	300690	双一科技	407,800	6,512,566.00	0.10
250	300717	华信新材	381,900	6,511,395.00	0.10
251	300221	银禧科技	1,051,361	6,507,924.59	0.10
252	002379	宏创控股	1,537,200	6,502,356.00	0.10
253	601212	白银有色	2,389,700	6,499,984.00	0.10
254	300088	长信科技	1,076,700	6,492,501.00	0.10
255	600502	安徽建工	1,229,380	6,491,126.40	0.10
256	300608	思特奇	671,400	6,485,724.00	0.10
257	605088	冠盛股份	377,700	6,477,555.00	0.10
258	002381	双箭股份	838,500	6,473,220.00	0.10
259	600135	乐凯胶片	857,100	6,462,534.00	0.10
260	600728	佳都科技	928,800	6,436,584.00	0.10
261	300399	天利科技	487,500	6,410,625.00	0.10
262	300925	法本信息	453,500	6,407,955.00	0.10
263	002388	新亚制程	897,900	6,393,048.00	0.10
264	002046	国机精工	499,800	6,377,448.00	0.10
265	002879	长缆科技	385,909	6,355,921.23	0.10
266	600362	江西铜业	333,800	6,335,524.00	0.10
267	603106	恒银科技	1,119,700	6,315,108.00	0.10
268	600269	赣粤高速	1,716,300	6,298,821.00	0.10
269	002136	安纳达	553,300	6,296,554.00	0.10
270	002397	梦洁股份	1,810,900	6,283,823.00	0.10
271	300868	杰美特	344,189	6,264,239.80	0.10
272	002063	远光软件	721,100	6,259,148.00	0.10
273	600126	杭钢股份	1,437,800	6,240,052.00	0.10
274	600033	福建高速	1,991,900	6,234,647.00	0.10
275	002114	罗平锌电	942,100	6,227,281.00	0.10
276	002479	富春环保	1,335,400	6,222,964.00	0.10
277	002492	恒基达鑫	1,080,800	6,214,600.00	0.10
278	002736	国信证券	709,600	6,194,808.00	0.10
279	301052	果麦文化	125,600	6,194,592.00	0.10
280	600694	大商股份	348,400	6,177,132.00	0.10

281	601598	中国外运	1,325,300	6,175,898.00	0.10
282	000507	珠海港	1,115,500	6,168,715.00	0.10
283	002364	中恒电气	735,000	6,166,650.00	0.10
284	000517	荣安地产	2,021,400	6,165,270.00	0.10
285	002676	顺威股份	1,529,600	6,164,288.00	0.10
286	300192	科德教育	495,800	6,138,004.00	0.10
287	002628	成都路桥	1,872,100	6,103,046.00	0.10
288	300971	博亚精工	231,800	6,084,750.00	0.10
289	300121	阳谷华泰	636,100	6,074,755.00	0.10
290	002457	青龙管业	675,800	6,068,684.00	0.10
291	300382	斯莱克	459,643	6,062,691.17	0.10
292	600958	东方证券	624,070	6,053,479.00	0.10
293	002017	东信和平	461,340	6,048,167.40	0.10
294	002566	益盛药业	725,600	6,036,992.00	0.10
295	600373	中文传媒	453,200	6,036,624.00	0.10
296	300018	中元股份	884,100	6,020,721.00	0.10
297	002521	齐峰新材	956,600	6,017,014.00	0.10
298	600455	博通股份	265,500	5,997,645.00	0.10
299	002753	永东股份	821,900	5,991,651.00	0.10
300	688148	芳源股份	490,082	5,979,000.40	0.10
301	601058	赛轮轮胎	524,900	5,978,611.00	0.10
302	600533	栖霞建设	1,938,300	5,969,964.00	0.10
303	603189	网达软件	404,400	5,940,636.00	0.10
304	002526	山东矿机	2,373,500	5,933,750.00	0.10
305	600512	腾达建设	2,210,100	5,923,068.00	0.10
306	600261	阳光照明	1,619,100	5,909,715.00	0.09
307	002111	威海广泰	616,360	5,880,074.40	0.09
308	300481	濮阳惠成	285,900	5,878,104.00	0.09
309	000923	河钢资源	434,700	5,868,450.00	0.09
310	300376	易事特	875,100	5,863,170.00	0.09
311	603519	立霸股份	394,700	5,849,454.00	0.09
312	001696	宗申动力	825,967	5,847,846.36	0.09
313	002130	沃尔核材	718,000	5,830,160.00	0.09
314	002404	嘉欣丝绸	864,000	5,823,360.00	0.09
315	002797	第一创业	1,017,800	5,821,816.00	0.09
316	600970	中材国际	455,000	5,801,250.00	0.09
317	600356	恒丰纸业	740,700	5,799,681.00	0.09
318	600495	晋西车轴	1,317,100	5,795,240.00	0.09
319	300386	飞天诚信	544,400	5,792,416.00	0.09
320	002774	快意电梯	727,900	5,786,805.00	0.09
321	002029	七匹狼	908,100	5,766,435.00	0.09
322	000060	中金岭南	1,212,400	5,758,900.00	0.09
323	000544	中原环保	801,700	5,756,206.00	0.09

324	300701	森霸传感	526,375	5,753,278.75	0.09
325	300831	派瑞股份	435,600	5,745,564.00	0.09
326	002402	和而泰	338,290	5,744,164.20	0.09
327	300641	正丹股份	1,063,870	5,734,259.30	0.09
328	600527	江南高纤	2,936,600	5,726,370.00	0.09
329	300721	怡达股份	350,940	5,713,303.20	0.09
330	000650	仁和药业	930,300	5,712,042.00	0.09
331	300644	南京聚隆	306,600	5,696,628.00	0.09
332	002636	金安国纪	614,700	5,673,681.00	0.09
333	002363	隆基机械	755,800	5,668,500.00	0.09
334	000655	金岭矿业	896,800	5,658,808.00	0.09
335	002887	绿茵生态	621,600	5,650,344.00	0.09
336	603508	思维列控	330,300	5,631,615.00	0.09
337	002871	伟隆股份	425,120	5,611,584.00	0.09
338	300771	智莱科技	512,333	5,579,306.37	0.09
339	600960	渤海汽车	1,479,500	5,577,715.00	0.09
340	000062	深圳华强	488,400	5,577,528.00	0.09
341	601008	连云港	1,312,600	5,565,424.00	0.09
342	600513	联环药业	574,100	5,545,806.00	0.09
343	002972	科安达	438,380	5,545,507.00	0.09
344	600713	南京医药	1,028,200	5,521,434.00	0.09
345	600990	四创电子	174,290	5,514,535.60	0.09
346	603656	泰禾智能	392,300	5,503,969.00	0.09
347	300515	三德科技	340,900	5,495,308.00	0.09
348	002332	仙琚制药	414,100	5,486,825.00	0.09
349	300400	劲拓股份	341,500	5,477,660.00	0.09
350	300621	维业股份	546,500	5,470,465.00	0.09
351	002215	诺普信	726,500	5,456,015.00	0.09
352	300484	蓝海华腾	387,400	5,446,844.00	0.09
353	002462	嘉事堂	397,000	5,430,960.00	0.09
354	002420	毅昌科技	885,600	5,428,728.00	0.09
355	300797	钢研纳克	294,000	5,421,360.00	0.09
356	603682	锦和商管	1,030,200	5,408,550.00	0.09
357	600963	岳阳林纸	731,800	5,393,366.00	0.09
358	300102	乾照光电	814,400	5,358,752.00	0.09
359	002949	华阳国际	376,600	5,355,252.00	0.09
360	300719	安达维尔	378,100	5,338,772.00	0.09
361	000078	海王生物	1,656,100	5,332,642.00	0.09
362	300951	博硕科技	97,400	5,320,962.00	0.09
363	002065	东华软件	753,100	5,316,886.00	0.09
364	300667	必创科技	270,000	5,316,300.00	0.09
365	002081	金螳螂	1,170,000	5,276,700.00	0.08
366	300384	三联虹普	310,500	5,275,395.00	0.08

367	600120	浙江东方	1,377,000	5,273,910.00	0.08
368	603386	骏亚科技	463,880	5,265,038.00	0.08
369	603758	秦安股份	494,100	5,257,224.00	0.08
370	603585	苏利股份	352,200	5,240,736.00	0.08
371	600202	哈空调	936,800	5,236,712.00	0.08
372	603677	奇精机械	386,900	5,234,757.00	0.08
373	600206	有研新材	397,400	5,221,836.00	0.08
374	603311	金海高科	419,600	5,203,040.00	0.08
375	600064	南京高科	787,020	5,202,202.20	0.08
376	002743	富煌钢构	904,400	5,200,300.00	0.08
377	600880	博瑞传播	926,700	5,189,520.00	0.08
378	000055	方大集团	1,041,800	5,156,910.00	0.08
379	300664	鹏鹞环保	907,800	5,138,148.00	0.08
380	603878	武进不锈	607,357	5,132,166.65	0.08
381	002718	友邦吊顶	338,400	5,130,144.00	0.08
382	002523	天桥起重	1,761,100	5,124,801.00	0.08
383	002026	山东威达	541,500	5,090,100.00	0.08
384	300501	海顺新材	304,200	5,067,972.00	0.08
385	300708	聚灿光电	513,440	5,067,652.80	0.08
386	300703	创源股份	531,400	5,058,928.00	0.08
387	600528	中铁工业	511,600	5,054,608.00	0.08
388	600271	航天信息	368,900	5,050,241.00	0.08
389	002461	珠江啤酒	571,200	5,032,272.00	0.08
390	000886	海南高速	997,600	5,027,904.00	0.08
391	002788	鹭燕医药	527,500	5,027,075.00	0.08
392	603928	兴业股份	416,400	5,025,948.00	0.08
393	301021	英诺激光	191,700	5,011,038.00	0.08
394	000719	中原传媒	427,500	5,001,750.00	0.08
395	600635	大众公用	1,506,100	5,000,252.00	0.08
396	603817	海峡环保	808,000	4,985,360.00	0.08
397	603138	海量数据	261,400	4,977,056.00	0.08
398	300590	移为通信	406,750	4,970,485.00	0.08
399	002811	郑中设计	626,300	4,966,559.00	0.08
400	300247	融捷健康	1,460,500	4,965,700.00	0.08
401	300840	酷特智能	394,500	4,962,810.00	0.08
402	300388	节能国祯	735,280	4,933,728.80	0.08
403	603041	美思德	410,000	4,928,200.00	0.08
404	600351	亚宝药业	693,700	4,925,270.00	0.08
405	003015	日久光电	519,700	4,921,559.00	0.08
406	300137	先河环保	869,200	4,919,672.00	0.08
407	002448	中原内配	701,000	4,907,000.00	0.08
408	601368	绿城水务	925,800	4,906,740.00	0.08
409	603289	泰瑞机器	436,480	4,897,305.60	0.08

410	600026	中远海能	384,400	4,858,816.00	0.08
411	002660	茂硕电源	504,500	4,858,335.00	0.08
412	002559	亚威股份	546,710	4,854,784.80	0.08
413	601186	中国铁建	491,900	4,845,215.00	0.08
414	003816	中国广核	1,556,200	4,839,782.00	0.08
415	300473	德尔股份	267,500	4,831,050.00	0.08
416	600448	华纺股份	1,623,520	4,821,854.40	0.08
417	600959	江苏有线	1,426,400	4,821,232.00	0.08
418	601567	三星医疗	381,100	4,813,293.00	0.08
419	000666	经纬纺机	480,900	4,804,191.00	0.08
420	603320	迪贝电气	329,300	4,788,022.00	0.08
421	002326	永太科技	313,100	4,787,299.00	0.08
422	300126	锐奇股份	736,200	4,777,938.00	0.08
423	002961	瑞达期货	330,500	4,762,505.00	0.08
424	300307	慈星股份	693,200	4,734,556.00	0.08
425	601169	北京银行	1,020,200	4,723,526.00	0.08
426	603321	梅轮电梯	606,100	4,721,519.00	0.08
427	603681	永冠新材	329,933	4,711,443.24	0.08
428	600508	上海能源	320,000	4,697,600.00	0.08
429	603813	原尚股份	324,800	4,686,864.00	0.08
430	603725	天安新材	576,000	4,682,880.00	0.08
431	002691	冀凯股份	748,700	4,679,375.00	0.08
432	300765	新诺威	361,957	4,665,625.73	0.07
433	600171	上海贝岭	254,500	4,644,625.00	0.07
434	600019	宝钢股份	826,000	4,642,120.00	0.07
435	300150	世纪瑞尔	1,026,200	4,628,162.00	0.07
436	300342	天银机电	428,500	4,614,945.00	0.07
437	000869	张裕 A	149,880	4,595,320.80	0.07
438	601188	龙江交通	1,348,800	4,531,968.00	0.07
439	301139	元道通信	156,600	4,524,174.00	0.07
440	300323	华灿光电	659,700	4,518,945.00	0.07
441	601500	通用股份	1,102,100	4,507,589.00	0.07
442	300637	扬帆新材	627,500	4,505,450.00	0.07
443	300611	美力科技	466,200	4,494,168.00	0.07
444	300477	合纵科技	961,400	4,489,738.00	0.07
445	603663	三祥新材	299,700	4,480,515.00	0.07
446	603045	福达合金	295,600	4,475,384.00	0.07
447	603458	勘设股份	454,170	4,473,574.50	0.07
448	002185	华天科技	483,000	4,443,600.00	0.07
449	600790	轻纺城	1,020,920	4,420,583.60	0.07
450	300535	达威股份	303,357	4,416,877.92	0.07
451	002818	富森美	333,170	4,407,839.10	0.07
452	300542	新晨科技	369,700	4,406,824.00	0.07

453	605151	西上海	241,800	4,400,760.00	0.07
454	300349	金卡智能	316,800	4,397,184.00	0.07
455	002369	卓翼科技	783,500	4,387,600.00	0.07
456	000822	山东海化	642,800	4,377,468.00	0.07
457	002899	英派斯	292,000	4,371,240.00	0.07
458	601098	中南传媒	374,700	4,346,520.00	0.07
459	002212	天融信	446,370	4,329,789.00	0.07
460	300306	远方信息	342,100	4,313,881.00	0.07
461	002405	四维图新	372,200	4,310,076.00	0.07
462	600637	东方明珠	550,837	4,307,545.34	0.07
463	300631	久吾高科	122,800	4,295,544.00	0.07
464	002170	芭田股份	624,700	4,291,689.00	0.07
465	603226	菲林格尔	841,400	4,291,140.00	0.07
466	600715	文投控股	1,894,300	4,281,118.00	0.07
467	600853	龙建股份	1,009,600	4,270,608.00	0.07
468	603977	国泰集团	492,000	4,260,720.00	0.07
469	600628	新世界	587,600	4,248,348.00	0.07
470	300899	上海凯鑫	172,200	4,248,174.00	0.07
471	300405	科隆股份	774,620	4,237,171.40	0.07
472	600128	弘业股份	515,300	4,235,766.00	0.07
473	300767	震安科技	166,300	4,217,368.00	0.07
474	300155	安居宝	836,253	4,214,715.12	0.07
475	300749	顶固集创	458,400	4,212,696.00	0.07
476	000059	华锦股份	669,600	4,211,784.00	0.07
477	002609	捷顺科技	360,900	4,208,094.00	0.07
478	000088	盐田港	865,600	4,198,160.00	0.07
479	601963	重庆银行	530,400	4,195,464.00	0.07
480	000030	富奥股份	832,400	4,195,296.00	0.07
481	002990	盛视科技	113,700	4,184,160.00	0.07
482	002768	国恩股份	172,700	4,177,613.00	0.07
483	600894	广日股份	554,400	4,174,632.00	0.07
484	688038	中科通达	278,726	4,169,740.96	0.07
485	603898	好莱客	428,800	4,167,936.00	0.07
486	300591	万里马	620,800	4,165,568.00	0.07
487	002830	名雕股份	324,500	4,156,845.00	0.07
488	600678	四川金顶	778,000	4,154,520.00	0.07
489	600661	昂立教育	435,800	4,153,174.00	0.07
490	603602	纵横通信	337,500	4,147,875.00	0.07
491	601518	吉林高速	1,742,440	4,147,007.20	0.07
492	300569	天能重工	492,326	4,145,384.92	0.07
493	600901	江苏金租	1,001,960	4,138,094.80	0.07
494	300210	森远股份	1,342,000	4,133,360.00	0.07
495	002971	和远气体	160,700	4,121,955.00	0.07

496	000691	亚太实业	943,300	4,112,788.00	0.07
497	002297	博云新材	512,000	4,111,360.00	0.07
498	300512	中亚股份	452,400	4,098,744.00	0.07
499	002341	新纶新材	1,177,000	4,095,960.00	0.07
500	000605	渤海股份	646,100	4,083,352.00	0.07
501	301002	崧盛股份	197,100	4,068,144.00	0.07
502	300743	天地数码	258,700	4,066,764.00	0.07
503	300751	迈为股份	24,000	4,065,120.00	0.07
504	002094	青岛金王	1,111,400	4,056,610.00	0.07
505	000532	华金资本	365,700	4,055,613.00	0.07
506	600558	大西洋	1,021,300	4,054,561.00	0.07
507	300293	蓝英装备	338,100	4,030,152.00	0.06
508	600097	开创国际	421,900	4,020,707.00	0.06
509	600724	宁波富达	1,093,100	4,011,677.00	0.06
510	603036	如通股份	379,000	4,009,820.00	0.06
511	002606	大连电瓷	437,900	4,006,785.00	0.06
512	603696	安记食品	424,017	4,002,720.48	0.06
513	300785	值得买	152,550	3,993,759.00	0.06
514	002722	物产金轮	287,600	3,989,012.00	0.06
515	002931	锋龙股份	305,600	3,988,080.00	0.06
516	600231	凌钢股份	1,794,700	3,984,234.00	0.06
517	603810	丰山集团	289,000	3,979,530.00	0.06
518	603960	克来机电	213,200	3,976,180.00	0.06
519	600980	北矿科技	251,500	3,973,700.00	0.06
520	000985	大庆华科	245,000	3,969,000.00	0.06
521	002195	二三四五	1,372,400	3,966,236.00	0.06
522	601018	宁波港	1,168,300	3,960,537.00	0.06
523	002224	三力士	832,500	3,954,375.00	0.06
524	600883	博闻科技	520,600	3,951,354.00	0.06
525	603116	红蜻蜓	623,100	3,950,454.00	0.06
526	002373	千方科技	288,400	3,933,776.00	0.06
527	000541	佛山照明	688,700	3,932,477.00	0.06
528	300425	中建环能	762,000	3,916,680.00	0.06
529	002443	金洲管道	586,200	3,904,092.00	0.06
530	002042	华孚时尚	1,243,000	3,903,020.00	0.06
531	000559	万向钱潮	716,100	3,902,745.00	0.06
532	002780	三夫户外	286,600	3,897,760.00	0.06
533	002826	易明医药	353,800	3,895,338.00	0.06
534	002737	葵花药业	159,800	3,889,532.00	0.06
535	300519	新光药业	242,700	3,888,054.00	0.06
536	600908	无锡银行	724,200	3,881,712.00	0.06
537	600665	天地源	954,000	3,863,700.00	0.06
538	300139	晓程科技	409,500	3,849,300.00	0.06

539	300968	格林精密	431,400	3,835,146.00	0.06
540	600755	厦门国贸	495,005	3,831,338.70	0.06
541	002533	金杯电工	468,800	3,825,408.00	0.06
542	300900	广联航空	132,700	3,823,087.00	0.06
543	002486	嘉麟杰	1,294,300	3,818,185.00	0.06
544	601975	招商南油	1,334,300	3,816,098.00	0.06
545	603579	荣泰健康	182,300	3,813,716.00	0.06
546	000828	东莞控股	416,600	3,811,890.00	0.06
547	601928	凤凰传媒	334,300	3,811,020.00	0.06
548	300305	裕兴股份	350,602	3,786,501.60	0.06
549	002745	木林森	411,300	3,783,960.00	0.06
550	603421	鼎信通讯	362,000	3,782,900.00	0.06
551	600855	航天长峰	286,900	3,778,473.00	0.06
552	002890	弘宇股份	255,820	3,778,461.40	0.06
553	600621	华鑫股份	354,900	3,772,587.00	0.06
554	300930	屹通新材	151,000	3,767,450.00	0.06
555	600997	开滦股份	630,800	3,765,876.00	0.06
556	002361	神剑股份	929,700	3,765,285.00	0.06
557	300976	达瑞电子	73,900	3,746,730.00	0.06
558	600640	国脉文化	311,900	3,745,919.00	0.06
559	300883	龙利得	604,900	3,744,331.00	0.06
560	002712	思美传媒	569,200	3,733,952.00	0.06
561	300758	七彩化学	375,600	3,729,708.00	0.06
562	600793	宜宾纸业	303,200	3,726,328.00	0.06
563	300448	浩云科技	620,800	3,712,384.00	0.06
564	002282	博深股份	489,100	3,712,269.00	0.06
565	000636	风华高科	241,976	3,711,911.84	0.06
566	300163	先锋新材	1,148,000	3,708,040.00	0.06
567	601107	四川成渝	910,200	3,704,514.00	0.06
568	300348	长亮科技	354,500	3,700,980.00	0.06
569	300387	富邦股份	508,300	3,700,424.00	0.06
570	605287	德才股份	156,000	3,697,200.00	0.06
571	603601	再升科技	864,900	3,693,123.00	0.06
572	603967	中创物流	403,700	3,689,818.00	0.06
573	600433	冠豪高新	1,080,700	3,685,187.00	0.06
574	600843	上工申贝	634,501	3,680,105.80	0.06
575	300694	蠡湖股份	344,700	3,664,161.00	0.06
576	601163	三角轮胎	230,542	3,658,701.54	0.06
577	300040	九洲集团	583,500	3,658,545.00	0.06
578	002560	通达股份	383,000	3,646,160.00	0.06
579	001207	联科科技	217,600	3,638,272.00	0.06
580	000565	渝三峡 A	659,900	3,636,049.00	0.06
581	603776	永安行	252,500	3,636,000.00	0.06

582	000878	云南铜业	328,900	3,634,345.00	0.06
583	300230	永利股份	1,025,000	3,628,500.00	0.06
584	601512	中新集团	388,500	3,624,705.00	0.06
585	002144	宏达高科	323,300	3,617,727.00	0.06
586	002066	瑞泰科技	302,600	3,616,070.00	0.06
587	603068	博通集成	126,200	3,611,844.00	0.06
588	000096	广聚能源	446,400	3,580,128.00	0.06
589	603828	柯利达	1,199,700	3,575,106.00	0.06
590	600336	澳柯玛	620,300	3,572,928.00	0.06
591	000407	胜利股份	977,700	3,568,605.00	0.06
592	600493	凤竹纺织	635,400	3,558,240.00	0.06
593	600308	华泰股份	955,840	3,555,724.80	0.06
594	603815	交建股份	522,700	3,554,360.00	0.06
595	002915	中欣氟材	212,700	3,554,217.00	0.06
596	600939	重庆建工	1,039,000	3,553,380.00	0.06
597	688360	德马科技	160,008	3,550,577.52	0.06
598	002412	汉森制药	539,000	3,541,230.00	0.06
599	300645	正元智慧	129,500	3,537,940.00	0.06
600	002773	康弘药业	184,900	3,535,288.00	0.06
601	605208	永茂泰	352,770	3,534,755.40	0.06
602	603080	新疆火炬	248,900	3,531,891.00	0.06
603	301011	华立科技	150,730	3,531,603.90	0.06
604	600496	精工钢构	945,900	3,528,207.00	0.06
605	001229	魅视科技	105,900	3,526,470.00	0.06
606	002562	兄弟科技	827,500	3,525,150.00	0.06
607	002801	微光股份	129,500	3,504,270.00	0.06
608	603066	音飞储存	293,400	3,494,394.00	0.06
609	603488	展鹏科技	434,100	3,485,823.00	0.06
610	600847	万里股份	285,400	3,484,734.00	0.06
611	002084	海鸥住工	883,700	3,481,778.00	0.06
612	300746	汉嘉设计	324,700	3,480,784.00	0.06
613	300578	会畅通讯	182,100	3,474,468.00	0.06
614	002322	理工能科	333,500	3,468,400.00	0.06
615	002238	天威视讯	499,900	3,464,307.00	0.06
616	600616	金枫酒业	501,200	3,448,256.00	0.06
617	300439	美康生物	304,500	3,443,895.00	0.06
618	688199	久日新材	115,416	3,441,705.12	0.06
619	000599	青岛双星	805,200	3,438,204.00	0.06
620	002661	克明食品	312,200	3,437,322.00	0.06
621	600423	柳化股份	1,104,200	3,434,062.00	0.06
622	600386	北巴传媒	838,700	3,430,283.00	0.06
623	300417	南华仪器	319,000	3,426,060.00	0.05
624	600688	上海石化	1,097,500	3,413,225.00	0.05

625	002360	同德化工	459,300	3,412,599.00	0.05
626	300839	博汇股份	256,700	3,411,543.00	0.05
627	600967	内蒙一机	337,300	3,406,730.00	0.05
628	603607	京华激光	236,100	3,404,562.00	0.05
629	300790	宇瞳光学	222,900	3,396,996.00	0.05
630	605318	法狮龙	244,900	3,394,314.00	0.05
631	603115	海星股份	220,800	3,393,696.00	0.05
632	002584	西陇科学	627,300	3,387,420.00	0.05
633	300289	利德曼	603,900	3,381,840.00	0.05
634	603079	圣达生物	262,600	3,363,906.00	0.05
635	603037	凯众股份	245,310	3,353,387.70	0.05
636	002575	群兴玩具	625,600	3,353,216.00	0.05
637	600380	健康元	263,500	3,349,085.00	0.05
638	000709	河钢股份	1,481,300	3,347,738.00	0.05
639	002255	海陆重工	550,500	3,336,030.00	0.05
640	600623	华谊集团	534,501	3,329,941.23	0.05
641	300547	川环科技	198,800	3,313,996.00	0.05
642	002183	怡亚通	648,800	3,308,880.00	0.05
643	600325	华发股份	335,400	3,303,690.00	0.05
644	600178	东安动力	493,800	3,303,522.00	0.05
645	002451	摩恩电气	473,900	3,303,083.00	0.05
646	002416	爱施德	446,700	3,296,646.00	0.05
647	300272	开能健康	621,300	3,292,890.00	0.05
648	600099	林海股份	351,600	3,290,976.00	0.05
649	002061	浙江交科	737,800	3,290,588.00	0.05
650	603331	百达精工	222,000	3,281,160.00	0.05
651	002540	亚太科技	567,600	3,280,728.00	0.05
652	603225	新凤鸣	296,100	3,271,905.00	0.05
653	002715	登云股份	222,700	3,271,463.00	0.05
654	300712	永福股份	92,023	3,266,816.50	0.05
655	000429	粤高速 A	416,500	3,265,360.00	0.05
656	003003	天元股份	308,500	3,263,930.00	0.05
657	600829	人民同泰	463,200	3,260,928.00	0.05
658	300583	赛托生物	125,800	3,251,930.00	0.05
659	300176	派生科技	527,800	3,251,248.00	0.05
660	600735	新华锦	551,000	3,250,900.00	0.05
661	600871	石化油服	1,640,400	3,247,992.00	0.05
662	300292	吴通控股	831,600	3,243,240.00	0.05
663	002062	宏润建设	599,100	3,241,131.00	0.05
664	603600	永艺股份	340,300	3,236,253.00	0.05
665	600478	科力远	450,800	3,218,712.00	0.05
666	300383	光环新网	297,900	3,202,425.00	0.05
667	600113	浙江东日	440,433	3,193,139.25	0.05

668	603999	读者传媒	456,800	3,193,032.00	0.05
669	002522	浙江众成	623,300	3,191,296.00	0.05
670	300321	同大股份	196,000	3,188,920.00	0.05
671	605189	富春染织	194,300	3,188,463.00	0.05
672	000919	金陵药业	407,600	3,187,432.00	0.05
673	603701	德宏股份	224,500	3,185,655.00	0.05
674	600053	九鼎投资	256,900	3,177,853.00	0.05
675	000682	东方电子	326,300	3,171,636.00	0.05
676	000707	双环科技	372,651	3,167,533.50	0.05
677	300455	航天智装	275,800	3,157,910.00	0.05
678	603330	天洋新材	284,000	3,155,240.00	0.05
679	603823	百合花	254,440	3,155,056.00	0.05
680	002927	泰永长征	220,800	3,153,024.00	0.05
681	600864	哈投股份	616,800	3,151,848.00	0.05
682	002836	新宏泽	386,604	3,150,822.60	0.05
683	002787	华源控股	434,000	3,146,500.00	0.05
684	603903	中持股份	349,900	3,128,106.00	0.05
685	603586	金麒麟	194,900	3,112,553.00	0.05
686	300332	天壕环境	271,300	3,111,811.00	0.05
687	300179	四方达	292,400	3,099,440.00	0.05
688	300430	诚益通	187,700	3,098,927.00	0.05
689	000728	国元证券	474,800	3,095,696.00	0.05
690	000560	我爱我家	1,167,400	3,093,610.00	0.05
691	601528	瑞丰银行	637,700	3,092,845.00	0.05
692	300796	贝斯美	256,420	3,084,732.60	0.05
693	603657	春光科技	175,700	3,083,535.00	0.05
694	001216	华瓷股份	234,200	3,082,072.00	0.05
695	603023	威帝股份	752,800	3,071,424.00	0.05
696	300453	三鑫医疗	449,120	3,067,489.60	0.05
697	300610	晨化股份	264,000	3,065,040.00	0.05
698	002909	集泰股份	390,900	3,052,929.00	0.05
699	300085	银之杰	259,600	3,052,896.00	0.05
700	002998	优彩资源	429,200	3,047,320.00	0.05
701	002442	龙星化工	618,500	3,043,020.00	0.05
702	003008	开普检测	105,800	3,039,634.00	0.05
703	603026	胜华新材	51,300	3,039,525.00	0.05
704	605286	同力日升	105,100	3,039,492.00	0.05
705	002775	文科园林	808,700	3,032,625.00	0.05
706	600689	上海三毛	323,800	3,027,530.00	0.05
707	300132	青松股份	533,000	3,022,110.00	0.05
708	300800	力合科技	218,800	3,021,628.00	0.05
709	300642	透景生命	149,100	3,007,347.00	0.05
710	002727	一心堂	113,900	3,006,960.00	0.05

711	300066	三川智慧	550,300	3,004,638.00	0.05
712	000608	阳光股份	1,107,900	3,002,409.00	0.05
713	688350	富森科技	176,690	3,001,963.10	0.05
714	002822	中装建设	724,400	2,999,016.00	0.05
715	600379	宝光股份	293,700	2,995,740.00	0.05
716	600800	渤海化学	856,200	2,988,138.00	0.05
717	002455	百川股份	385,700	2,969,890.00	0.05
718	002543	万和电气	373,400	2,953,594.00	0.05
719	601577	长沙银行	380,139	2,949,878.64	0.05
720	603567	珍宝岛	196,800	2,944,128.00	0.05
721	000883	湖北能源	645,000	2,941,200.00	0.05
722	300136	信维通信	146,300	2,937,704.00	0.05
723	300021	大禹节水	589,000	2,927,330.00	0.05
724	300886	华业香料	126,000	2,926,980.00	0.05
725	002107	沃华医药	486,200	2,926,924.00	0.05
726	601956	东贝集团	493,400	2,920,928.00	0.05
727	300106	西部牧业	363,100	2,915,693.00	0.05
728	300411	金盾股份	445,100	2,915,405.00	0.05
729	000590	启迪药业	332,500	2,899,400.00	0.05
730	000705	浙江震元	359,400	2,893,170.00	0.05
731	600590	泰豪科技	405,200	2,889,076.00	0.05
732	601231	环旭电子	193,000	2,887,280.00	0.05
733	002783	凯龙股份	346,000	2,885,640.00	0.05
734	600933	爱柯迪	123,700	2,880,973.00	0.05
735	300435	中泰股份	199,500	2,880,780.00	0.05
736	300956	英力股份	183,100	2,880,163.00	0.05
737	300932	三友联众	186,530	2,880,023.20	0.05
738	002577	雷柏科技	172,612	2,873,989.80	0.05
739	601996	丰林集团	1,165,600	2,867,376.00	0.05
740	600889	南京化纤	608,300	2,865,093.00	0.05
741	002233	塔牌集团	371,000	2,864,120.00	0.05
742	605500	森林包装	383,928	2,864,102.88	0.05
743	300457	赢合科技	161,600	2,853,856.00	0.05
744	002300	太阳电缆	324,000	2,847,960.00	0.05
745	300786	国林科技	150,300	2,824,137.00	0.05
746	300732	设研院	283,540	2,821,223.00	0.05
747	000729	燕京啤酒	225,600	2,813,232.00	0.05
748	603088	宁波精达	335,600	2,812,328.00	0.05
749	002673	西部证券	442,852	2,812,110.20	0.05
750	000632	三木集团	663,700	2,807,451.00	0.05
751	003018	金富科技	289,400	2,798,498.00	0.04
752	603379	三美股份	118,700	2,790,637.00	0.04
753	301067	显盈科技	128,400	2,787,564.00	0.04

754	603086	先达股份	406,220	2,782,607.00	0.04
755	600439	瑞贝卡	1,113,000	2,782,500.00	0.04
756	600255	鑫科材料	1,352,100	2,771,805.00	0.04
757	600201	生物股份	291,300	2,770,263.00	0.04
758	300172	中电环保	578,300	2,770,057.00	0.04
759	600292	远达环保	474,900	2,768,667.00	0.04
760	300117	嘉寓股份	891,800	2,764,580.00	0.04
761	002335	科华数据	76,900	2,764,555.00	0.04
762	301076	新瀚新材	140,640	2,759,356.80	0.04
763	605166	聚合顺	296,000	2,758,720.00	0.04
764	000776	广发证券	187,000	2,750,770.00	0.04
765	002127	南极电商	717,500	2,748,025.00	0.04
766	002115	三维通信	421,300	2,746,876.00	0.04
767	601006	大秦铁路	368,607	2,738,750.01	0.04
768	300756	金马游乐	143,100	2,736,072.00	0.04
769	300941	创识科技	134,000	2,725,560.00	0.04
770	605177	东亚药业	110,600	2,725,184.00	0.04
771	603222	济民医疗	260,700	2,719,101.00	0.04
772	300079	数码视讯	444,400	2,710,840.00	0.04
773	300340	科恒股份	212,200	2,709,794.00	0.04
774	000718	苏宁环球	988,700	2,699,151.00	0.04
775	300082	奥克股份	355,100	2,691,658.00	0.04
776	000536	华映科技	1,483,400	2,684,954.00	0.04
777	002423	中粮资本	335,500	2,684,000.00	0.04
778	601811	新华文轩	189,400	2,681,904.00	0.04
779	002696	百洋股份	429,600	2,680,704.00	0.04
780	603385	惠达卫浴	355,700	2,678,421.00	0.04
781	600332	白云山	83,800	2,671,544.00	0.04
782	300589	江龙船艇	170,400	2,670,168.00	0.04
783	605196	华通线缆	374,400	2,665,728.00	0.04
784	601137	博威合金	171,300	2,665,428.00	0.04
785	000628	高新发展	164,300	2,650,159.00	0.04
786	000548	湖南投资	547,311	2,648,985.24	0.04
787	603858	步长制药	128,600	2,647,874.00	0.04
788	002986	宇新股份	95,900	2,644,922.00	0.04
789	002883	中设股份	223,900	2,639,781.00	0.04
790	002004	华邦健康	527,600	2,638,000.00	0.04
791	300329	海伦钢琴	372,800	2,635,696.00	0.04
792	688135	利扬芯片	120,042	2,632,521.06	0.04
793	300920	润阳科技	152,800	2,629,688.00	0.04
794	600012	皖通高速	250,700	2,627,336.00	0.04
795	600409	三友化工	481,800	2,625,810.00	0.04
796	301059	金三江	187,460	2,624,440.00	0.04

797	300808	久量股份	194,400	2,624,400.00	0.04
798	300120	经纬辉开	340,200	2,622,942.00	0.04
799	600697	欧亚集团	212,700	2,618,337.00	0.04
800	601555	东吴证券	376,400	2,612,216.00	0.04
801	300707	威唐工业	166,600	2,603,958.00	0.04
802	603389	亚振家居	487,100	2,591,372.00	0.04
803	600172	黄河旋风	600,060	2,568,256.80	0.04
804	300410	正业科技	301,530	2,566,020.30	0.04
805	300134	大富科技	249,900	2,561,475.00	0.04
806	002325	洪涛股份	1,775,550	2,556,792.00	0.04
807	600435	北方导航	222,500	2,556,525.00	0.04
808	300955	嘉亨家化	119,400	2,543,220.00	0.04
809	603958	哈森股份	331,300	2,541,071.00	0.04
810	000751	锌业股份	769,200	2,538,360.00	0.04
811	601519	大智慧	354,200	2,536,072.00	0.04
812	300929	华骐环保	223,063	2,527,303.79	0.04
813	300067	安诺其	866,600	2,521,806.00	0.04
814	600750	江中药业	114,900	2,519,757.00	0.04
815	300987	川网传媒	132,800	2,511,248.00	0.04
816	603238	诺邦股份	199,100	2,510,651.00	0.04
817	603661	恒林股份	75,700	2,510,212.00	0.04
818	603166	福达股份	372,200	2,508,628.00	0.04
819	300245	天玑科技	262,600	2,507,830.00	0.04
820	301008	宏昌科技	88,900	2,500,757.00	0.04
821	000727	冠捷科技	1,171,600	2,483,792.00	0.04
822	300830	金现代	260,200	2,471,900.00	0.04
823	300819	聚杰微纤	180,200	2,470,542.00	0.04
824	300243	瑞丰高材	280,300	2,466,640.00	0.04
825	300270	中威电子	321,400	2,458,710.00	0.04
826	603053	成都燃气	243,900	2,456,073.00	0.04
827	601619	嘉泽新能	538,100	2,448,355.00	0.04
828	300640	德艺文创	407,300	2,447,873.00	0.04
829	300872	天阳科技	157,500	2,447,550.00	0.04
830	000036	华联控股	593,800	2,446,456.00	0.04
831	688028	沃尔德	109,199	2,446,057.60	0.04
832	300940	南极光	143,500	2,440,935.00	0.04
833	600987	航民股份	296,400	2,439,372.00	0.04
834	000501	武商集团	246,600	2,438,874.00	0.04
835	688296	和达科技	136,582	2,437,988.70	0.04
836	300552	万集科技	125,200	2,436,392.00	0.04
837	600552	凯盛科技	205,500	2,433,120.00	0.04
838	300127	银河磁体	134,200	2,433,046.00	0.04
839	603733	仙鹤股份	116,200	2,422,770.00	0.04

840	002798	帝欧家居	357,700	2,421,629.00	0.04
841	002483	润邦股份	417,000	2,418,600.00	0.04
842	600321	正源股份	1,445,800	2,414,486.00	0.04
843	000598	兴蓉环境	443,700	2,409,291.00	0.04
844	603989	艾华集团	114,300	2,407,158.00	0.04
845	600784	鲁银投资	332,100	2,404,404.00	0.04
846	603109	神驰机电	134,500	2,400,825.00	0.04
847	603316	诚邦股份	390,800	2,399,512.00	0.04
848	000573	粤宏远 A	704,800	2,396,320.00	0.04
849	002394	联发股份	281,500	2,395,565.00	0.04
850	600718	东软集团	223,400	2,381,444.00	0.04
851	002452	长高电新	323,300	2,379,488.00	0.04
852	300850	新强联	63,500	2,373,630.00	0.04
853	600067	冠城大通	894,100	2,369,365.00	0.04
854	603059	倍加洁	103,800	2,360,412.00	0.04
855	601020	华钰矿业	274,100	2,354,519.00	0.04
856	300862	蓝盾光电	76,400	2,353,120.00	0.04
857	300371	汇中股份	179,020	2,345,162.00	0.04
858	600444	国机通用	170,600	2,342,338.00	0.04
859	300787	海能实业	118,850	2,341,345.00	0.04
860	300906	日月明	93,000	2,336,160.00	0.04
861	300562	乐心医疗	237,800	2,330,440.00	0.04
862	002969	嘉美包装	594,100	2,322,931.00	0.04
863	000419	通程控股	422,101	2,317,334.49	0.04
864	603838	四通股份	410,226	2,309,572.38	0.04
865	600180	瑞茂通	386,000	2,308,280.00	0.04
866	600419	天润乳业	142,300	2,308,106.00	0.04
867	600173	卧龙地产	437,800	2,307,206.00	0.04
868	603706	东方环宇	153,200	2,305,660.00	0.04
869	002110	三钢闽光	545,200	2,300,744.00	0.04
870	300091	金通灵	771,900	2,300,262.00	0.04
871	603089	正裕工业	258,500	2,298,065.00	0.04
872	600594	益佰制药	435,200	2,293,504.00	0.04
873	300354	东华测试	51,300	2,293,110.00	0.04
874	600052	东望时代	532,100	2,282,709.00	0.04
875	002243	力合科创	266,200	2,265,362.00	0.04
876	002393	力生制药	92,700	2,261,880.00	0.04
877	300864	南大环境	102,800	2,259,544.00	0.04
878	603121	华培动力	253,300	2,256,903.00	0.04
879	301063	海锅股份	81,000	2,256,660.00	0.04
880	000859	国风新材	455,600	2,255,220.00	0.04
881	600742	一汽富维	274,800	2,250,612.00	0.04
882	002218	拓日新能	468,500	2,248,800.00	0.04

883	300485	赛升药业	219,700	2,247,531.00	0.04
884	603757	大元泵业	75,200	2,243,968.00	0.04
885	000850	华茂股份	604,200	2,241,582.00	0.04
886	000913	钱江摩托	122,900	2,240,467.00	0.04
887	600708	光明地产	1,046,500	2,239,510.00	0.04
888	600651	飞乐音响	534,300	2,233,374.00	0.04
889	002334	英威腾	174,500	2,223,130.00	0.04
890	600319	亚星化学	441,600	2,216,832.00	0.04
891	000409	云鼎科技	221,401	2,211,795.99	0.04
892	600353	旭光电子	269,300	2,208,260.00	0.04
893	600355	精伦电子	636,900	2,203,674.00	0.04
894	601860	紫金银行	877,700	2,203,027.00	0.04
895	300876	蒙泰高新	84,400	2,198,620.00	0.04
896	002688	金河生物	465,500	2,197,160.00	0.04
897	002051	中工国际	183,600	2,190,348.00	0.04
898	000905	厦门港务	281,300	2,188,514.00	0.04
899	002511	中顺洁柔	196,200	2,187,630.00	0.04
900	688597	煜邦电力	216,373	2,185,367.30	0.04
901	002140	东华科技	241,776	2,183,237.28	0.04
902	002441	众业达	191,500	2,183,100.00	0.04
903	002209	达意隆	211,700	2,169,925.00	0.03
904	002823	凯中精密	200,800	2,168,640.00	0.03
905	000576	甘化科工	204,400	2,166,640.00	0.03
906	600266	城建发展	426,400	2,166,112.00	0.03
907	300407	凯发电气	237,000	2,163,810.00	0.03
908	300096	易联众	352,400	2,163,736.00	0.03
909	301379	天山电子	77,400	2,161,782.00	0.03
910	000607	华媒控股	428,900	2,161,656.00	0.03
911	300507	苏奥传感	331,400	2,160,728.00	0.03
912	000856	冀东装备	248,900	2,160,452.00	0.03
913	300004	南风股份	399,900	2,159,460.00	0.03
914	000885	城发环境	162,000	2,156,220.00	0.03
915	603515	欧普照明	106,200	2,155,860.00	0.03
916	002489	浙江永强	532,000	2,154,600.00	0.03
917	002117	东港股份	204,400	2,154,376.00	0.03
918	002400	省广集团	447,600	2,152,956.00	0.03
919	301040	中环海陆	104,600	2,149,530.00	0.03
920	300654	世纪天鸿	163,600	2,146,432.00	0.03
921	601010	文峰股份	875,700	2,145,465.00	0.03
922	603709	中源家居	118,100	2,142,334.00	0.03
923	002632	道明光学	293,800	2,138,864.00	0.03
924	601827	三峰环境	288,900	2,137,860.00	0.03
925	000717	中南股份	765,500	2,128,090.00	0.03

926	000782	美达股份	388,300	2,127,884.00	0.03
927	000521	长虹美菱	278,400	2,126,976.00	0.03
928	600876	凯盛新能	133,100	2,124,276.00	0.03
929	600969	郴电国际	283,960	2,121,181.20	0.03
930	600756	浪潮软件	127,600	2,120,712.00	0.03
931	002817	黄山胶囊	243,900	2,117,052.00	0.03
932	603577	汇金通	215,400	2,115,228.00	0.03
933	002172	澳洋健康	602,400	2,114,424.00	0.03
934	600007	中国国贸	114,000	2,111,280.00	0.03
935	002189	中光学	119,700	2,098,341.00	0.03
936	001225	和泰机电	45,700	2,094,888.00	0.03
937	601187	厦门银行	417,200	2,094,344.00	0.03
938	003036	泰坦股份	155,300	2,093,444.00	0.03
939	002702	海欣食品	398,700	2,093,175.00	0.03
940	603336	宏辉果蔬	416,000	2,092,480.00	0.03
941	603768	常青股份	117,200	2,082,644.00	0.03
942	300385	雪浪环境	340,100	2,081,412.00	0.03
943	600218	全柴动力	232,300	2,081,408.00	0.03
944	603689	皖天然气	237,300	2,081,121.00	0.03
945	600794	保税科技	589,500	2,075,040.00	0.03
946	000759	中百集团	459,700	2,073,247.00	0.03
947	300692	中环环保	283,300	2,070,923.00	0.03
948	601608	中信重工	491,600	2,069,636.00	0.03
949	605155	西大门	142,600	2,069,126.00	0.03
950	000910	大亚圣象	263,300	2,056,373.00	0.03
951	000712	锦龙股份	164,400	2,051,712.00	0.03
952	600758	辽宁能源	437,200	2,041,724.00	0.03
953	301036	双乐股份	109,000	2,041,570.00	0.03
954	002283	天润工业	317,800	2,040,276.00	0.03
955	301106	骏成科技	57,200	2,037,464.00	0.03
956	603980	吉华集团	475,500	2,030,385.00	0.03
957	002445	中南文化	838,500	2,029,170.00	0.03
958	002105	信隆健康	339,700	2,021,215.00	0.03
959	603727	博迈科	169,800	2,007,036.00	0.03
960	300047	天源迪科	246,400	2,005,696.00	0.03
961	002495	佳隆股份	821,300	2,003,972.00	0.03
962	603839	安正时尚	265,400	1,995,808.00	0.03
963	300923	研奥股份	88,200	1,993,320.00	0.03
964	603161	科华控股	136,700	1,991,719.00	0.03
965	300381	溢多利	282,400	1,988,096.00	0.03
966	300670	大烨智能	227,500	1,981,525.00	0.03
967	601992	金隅集团	905,200	1,973,336.00	0.03
968	300218	安利股份	209,400	1,972,548.00	0.03

969	002510	天汽模	504,600	1,962,894.00	0.03
970	600796	钱江生化	373,027	1,954,661.48	0.03
971	300169	天晟新材	467,400	1,953,732.00	0.03
972	000897	津滨发展	1,027,900	1,953,010.00	0.03
973	605086	龙高股份	93,900	1,951,242.00	0.03
974	601636	旗滨集团	225,900	1,947,258.00	0.03
975	002876	三利谱	58,700	1,947,079.00	0.03
976	000951	中国重汽	115,400	1,944,490.00	0.03
977	002512	达华智能	484,900	1,944,449.00	0.03
978	300752	隆利科技	114,100	1,943,123.00	0.03
979	000997	新大陆	102,300	1,933,470.00	0.03
980	002669	康达新材	144,300	1,926,405.00	0.03
981	603002	宏昌电子	373,500	1,923,525.00	0.03
982	688077	大地熊	63,603	1,921,446.63	0.03
983	300564	筑博设计	144,000	1,920,960.00	0.03
984	601113	华鼎股份	591,400	1,916,136.00	0.03
985	000026	飞亚达	158,700	1,913,922.00	0.03
986	002285	世联行	746,800	1,911,808.00	0.03
987	000922	佳电股份	145,120	1,909,779.20	0.03
988	002611	东方精工	332,600	1,909,124.00	0.03
989	300865	大宏立	88,000	1,902,560.00	0.03
990	002067	景兴纸业	550,700	1,899,915.00	0.03
991	002622	皓宸医疗	599,600	1,894,736.00	0.03
992	002494	华斯股份	408,500	1,891,355.00	0.03
993	000677	恒天海龙	694,600	1,889,312.00	0.03
994	601515	东风股份	430,700	1,886,466.00	0.03
995	600569	安阳钢铁	946,000	1,882,540.00	0.03
996	603535	嘉诚国际	115,915	1,882,459.60	0.03
997	002734	利民股份	203,848	1,879,478.56	0.03
998	688600	皖仪科技	75,788	1,878,784.52	0.03
999	002666	德联集团	363,300	1,878,261.00	0.03
1,000	002686	亿利达	266,200	1,876,710.00	0.03
1,001	603787	新日股份	111,600	1,875,996.00	0.03
1,002	600664	哈药股份	569,300	1,872,997.00	0.03
1,003	603615	茶花股份	197,800	1,867,232.00	0.03
1,004	600476	湘邮科技	113,300	1,852,455.00	0.03
1,005	300668	杰恩设计	78,500	1,832,975.00	0.03
1,006	003041	真爱美家	115,520	1,832,147.20	0.03
1,007	000652	泰达股份	440,300	1,814,036.00	0.03
1,008	002109	兴化股份	393,100	1,812,191.00	0.03
1,009	003002	壶化股份	114,500	1,811,390.00	0.03
1,010	000932	华菱钢铁	379,700	1,811,169.00	0.03
1,011	002802	洪汇新材	163,620	1,809,637.20	0.03

1,012	300963	中洲特材	126,850	1,800,001.50	0.03
1,013	603221	爱丽家居	231,300	1,797,201.00	0.03
1,014	002319	乐通股份	109,100	1,793,604.00	0.03
1,015	003027	同兴环保	85,900	1,791,015.00	0.03
1,016	002392	北京利尔	493,700	1,787,194.00	0.03
1,017	600051	宁波联合	243,900	1,775,592.00	0.03
1,018	601869	长飞光纤	47,800	1,769,078.00	0.03
1,019	300391	长药控股	239,700	1,766,589.00	0.03
1,020	600192	长城电工	304,700	1,764,213.00	0.03
1,021	605577	龙版传媒	154,200	1,756,338.00	0.03
1,022	600761	安徽合力	88,100	1,755,833.00	0.03
1,023	002128	电投能源	132,700	1,754,294.00	0.03
1,024	002377	国创高新	730,800	1,753,920.00	0.03
1,025	300441	鲍斯股份	286,200	1,748,682.00	0.03
1,026	002467	二六三	349,600	1,737,512.00	0.03
1,027	301039	中集车辆	131,300	1,737,099.00	0.03
1,028	301182	凯旺科技	75,600	1,736,532.00	0.03
1,029	000959	首钢股份	495,700	1,734,950.00	0.03
1,030	002228	合兴包装	536,100	1,731,603.00	0.03
1,031	601139	深圳燃气	237,395	1,730,609.55	0.03
1,032	605305	中际联合	49,600	1,729,056.00	0.03
1,033	300652	雷迪克	75,477	1,718,611.29	0.03
1,034	003012	东鹏控股	212,200	1,716,698.00	0.03
1,035	603808	歌力思	130,200	1,709,526.00	0.03
1,036	300854	中兰环保	107,200	1,704,480.00	0.03
1,037	301234	五洲医疗	57,500	1,701,425.00	0.03
1,038	603578	三星新材	116,630	1,694,633.90	0.03
1,039	600673	东阳光	235,000	1,694,350.00	0.03
1,040	603655	朗博科技	67,400	1,689,044.00	0.03
1,041	002201	正威新材	177,316	1,686,275.16	0.03
1,042	603111	康尼机电	337,000	1,681,630.00	0.03
1,043	002732	燕塘乳业	77,600	1,677,712.00	0.03
1,044	603697	有友食品	182,520	1,673,708.40	0.03
1,045	601002	晋亿实业	335,200	1,662,592.00	0.03
1,046	000737	北方铜业	308,100	1,660,659.00	0.03
1,047	000833	粤桂股份	254,100	1,659,273.00	0.03
1,048	000510	新金路	268,900	1,659,113.00	0.03
1,049	002687	乔治白	344,600	1,654,080.00	0.03
1,050	002940	昂利康	85,855	1,649,274.55	0.03
1,051	000554	泰山石油	292,700	1,647,901.00	0.03
1,052	002682	龙洲股份	403,600	1,646,688.00	0.03
1,053	600185	格力地产	239,100	1,640,226.00	0.03
1,054	002425	凯撒文化	291,000	1,638,330.00	0.03

1,055	300720	海川智能	129,400	1,636,910.00	0.03
1,056	003028	振邦智能	38,900	1,626,409.00	0.03
1,057	300813	泰林生物	56,920	1,626,204.40	0.03
1,058	002274	华昌化工	216,400	1,620,836.00	0.03
1,059	603359	东珠生态	156,900	1,616,070.00	0.03
1,060	000972	中基健康	476,600	1,615,674.00	0.03
1,061	002578	闽发铝业	439,500	1,612,965.00	0.03
1,062	603113	金能科技	198,500	1,605,865.00	0.03
1,063	002644	佛慈制药	131,400	1,603,080.00	0.03
1,064	601677	明泰铝业	115,400	1,601,752.00	0.03
1,065	600828	茂业商业	431,400	1,596,180.00	0.03
1,066	000698	沈阳化工	388,300	1,595,913.00	0.03
1,067	000061	农产品	265,900	1,592,741.00	0.03
1,068	688026	洁特生物	87,075	1,590,860.25	0.03
1,069	002977	天箭科技	49,560	1,588,893.60	0.03
1,070	001238	浙江正特	67,400	1,585,922.00	0.03
1,071	600162	香江控股	793,800	1,579,662.00	0.03
1,072	003017	大洋生物	46,900	1,578,185.00	0.03
1,073	300149	睿智医药	201,866	1,576,573.46	0.03
1,074	600539	狮头股份	235,200	1,571,136.00	0.03
1,075	300055	万邦达	217,800	1,568,160.00	0.03
1,076	300128	锦富技术	375,400	1,565,418.00	0.03
1,077	600971	恒源煤电	200,900	1,565,011.00	0.03
1,078	001332	锡装股份	40,210	1,564,571.10	0.03
1,079	601128	常熟银行	229,100	1,562,462.00	0.03
1,080	300164	通源石油	356,800	1,555,648.00	0.02
1,081	603598	引力传媒	148,700	1,555,402.00	0.02
1,082	603139	康惠制药	93,600	1,533,168.00	0.02
1,083	000039	中集集团	222,000	1,529,580.00	0.02
1,084	002633	申科股份	145,900	1,529,032.00	0.02
1,085	300097	智云股份	228,500	1,528,665.00	0.02
1,086	600611	大众交通	515,800	1,526,768.00	0.02
1,087	601997	贵阳银行	295,600	1,525,296.00	0.02
1,088	300907	康平科技	71,000	1,524,370.00	0.02
1,089	600577	精达股份	361,200	1,524,264.00	0.02
1,090	600789	鲁抗医药	237,300	1,523,466.00	0.02
1,091	603726	朗迪集团	120,200	1,521,732.00	0.02
1,092	300235	方直科技	121,700	1,515,165.00	0.02
1,093	605369	拱东医疗	27,019	1,514,144.76	0.02
1,094	603950	长源东谷	101,000	1,510,960.00	0.02
1,095	002488	金固股份	218,100	1,504,890.00	0.02
1,096	605003	众望布艺	78,100	1,501,863.00	0.02
1,097	601019	山东出版	163,700	1,501,129.00	0.02

1,098	600692	亚通股份	268,000	1,495,440.00	0.02
1,099	603050	科林电气	92,520	1,490,497.20	0.02
1,100	603327	福蓉科技	124,760	1,482,148.80	0.02
1,101	002365	永安药业	152,000	1,480,480.00	0.02
1,102	300352	北信源	293,400	1,478,736.00	0.02
1,103	600210	紫江企业	277,400	1,475,768.00	0.02
1,104	605050	福然德	118,500	1,463,475.00	0.02
1,105	002810	山东赫达	81,100	1,459,800.00	0.02
1,106	300938	信测标准	33,300	1,458,540.00	0.02
1,107	605336	帅丰电器	84,500	1,453,400.00	0.02
1,108	600312	平高电气	117,100	1,450,869.00	0.02
1,109	600757	长江传媒	168,700	1,450,820.00	0.02
1,110	300877	金春股份	82,200	1,450,008.00	0.02
1,111	000779	甘咨询	132,200	1,448,912.00	0.02
1,112	300389	艾比森	71,100	1,448,307.00	0.02
1,113	603261	立航科技	42,100	1,448,240.00	0.02
1,114	300738	奥飞数据	141,700	1,445,340.00	0.02
1,115	600738	丽尚国潮	276,800	1,444,896.00	0.02
1,116	603020	爱普股份	157,700	1,444,532.00	0.02
1,117	001336	楚环科技	51,600	1,443,768.00	0.02
1,118	300986	志特新材	51,500	1,442,000.00	0.02
1,119	300873	海晨股份	72,400	1,440,036.00	0.02
1,120	002197	证通电子	136,300	1,436,602.00	0.02
1,121	300731	科创新源	68,600	1,435,798.00	0.02
1,122	002267	陕天然气	181,200	1,435,104.00	0.02
1,123	603777	来伊份	97,200	1,434,672.00	0.02
1,124	600156	华升股份	325,900	1,433,960.00	0.02
1,125	688676	金盘科技	47,339	1,433,898.31	0.02
1,126	002829	星网宇达	32,600	1,432,118.00	0.02
1,127	603360	百傲化学	141,120	1,430,956.80	0.02
1,128	002010	传化智联	268,900	1,430,548.00	0.02
1,129	600037	歌华有线	171,700	1,426,827.00	0.02
1,130	603018	华设集团	163,000	1,426,250.00	0.02
1,131	601068	中铝国际	265,900	1,425,224.00	0.02
1,132	600350	山东高速	223,100	1,421,147.00	0.02
1,133	601601	中国太保	54,500	1,415,910.00	0.02
1,134	002885	京泉华	64,780	1,414,795.20	0.02
1,135	000404	长虹华意	204,300	1,413,756.00	0.02
1,136	603506	南都物业	119,300	1,411,319.00	0.02
1,137	603160	汇顶科技	30,500	1,410,625.00	0.02
1,138	301003	江苏博云	61,000	1,409,710.00	0.02
1,139	300879	大叶股份	73,800	1,404,414.00	0.02
1,140	002590	万安科技	141,400	1,404,102.00	0.02

1,141	603218	日月股份	73,900	1,403,361.00	0.02
1,142	603499	翔港科技	147,000	1,402,380.00	0.02
1,143	603551	奥普家居	108,000	1,396,440.00	0.02
1,144	600561	江西长运	264,800	1,395,496.00	0.02
1,145	000042	中洲控股	186,500	1,395,020.00	0.02
1,146	301070	开勒股份	37,300	1,395,020.00	0.02
1,147	000933	神火股份	107,100	1,392,300.00	0.02
1,148	600015	华夏银行	257,300	1,391,993.00	0.02
1,149	600805	悦达投资	324,301	1,391,251.29	0.02
1,150	603356	华菱精工	98,600	1,390,260.00	0.02
1,151	300687	赛意信息	49,900	1,386,222.00	0.02
1,152	300798	锦鸡股份	192,000	1,374,720.00	0.02
1,153	300919	中伟股份	22,800	1,373,700.00	0.02
1,154	300095	华伍股份	145,200	1,373,592.00	0.02
1,155	301373	凌玮科技	42,400	1,373,336.00	0.02
1,156	600782	新钢股份	369,300	1,370,103.00	0.02
1,157	601158	重庆水务	246,400	1,369,984.00	0.02
1,158	600774	汉商集团	108,200	1,369,812.00	0.02
1,159	000156	华数传媒	157,400	1,369,380.00	0.02
1,160	002149	西部材料	81,300	1,365,027.00	0.02
1,161	300111	向日葵	443,000	1,364,440.00	0.02
1,162	002178	延华智能	362,800	1,364,128.00	0.02
1,163	601366	利群股份	254,900	1,363,715.00	0.02
1,164	600662	外服控股	238,000	1,361,360.00	0.02
1,165	300234	开尔新材	252,900	1,355,544.00	0.02
1,166	300695	兆丰股份	29,100	1,355,478.00	0.02
1,167	603093	南华期货	124,400	1,354,716.00	0.02
1,168	600470	六国化工	250,700	1,346,259.00	0.02
1,169	601218	吉鑫科技	360,800	1,345,784.00	0.02
1,170	000801	四川九洲	183,900	1,342,470.00	0.02
1,171	002092	中泰化学	208,000	1,341,600.00	0.02
1,172	001218	丽臣实业	59,200	1,338,512.00	0.02
1,173	003000	劲仔食品	106,300	1,338,317.00	0.02
1,174	002206	海利得	249,500	1,337,320.00	0.02
1,175	600559	老白干酒	54,500	1,335,795.00	0.02
1,176	603177	德创环保	107,000	1,335,360.00	0.02
1,177	002942	新农股份	73,530	1,334,569.50	0.02
1,178	603351	威尔药业	49,600	1,330,272.00	0.02
1,179	002855	捷荣技术	126,800	1,330,132.00	0.02
1,180	603558	健盛集团	159,900	1,320,774.00	0.02
1,181	002014	永新股份	151,500	1,315,020.00	0.02
1,182	002664	信质集团	93,200	1,312,256.00	0.02
1,183	688127	蓝特光学	74,106	1,306,488.78	0.02

1, 184	603303	得邦照明	94, 500	1, 305, 045. 00	0. 02
1, 185	300885	海昌新材	124, 700	1, 298, 127. 00	0. 02
1, 186	301238	瑞泰新材	63, 700	1, 295, 658. 00	0. 02
1, 187	603818	曲美家居	239, 900	1, 295, 460. 00	0. 02
1, 188	601888	中国中免	11, 700	1, 293, 201. 00	0. 02
1, 189	600538	国发股份	306, 300	1, 292, 586. 00	0. 02
1, 190	300918	南山智尚	94, 000	1, 290, 620. 00	0. 02
1, 191	688080	映翰通	26, 337	1, 287, 879. 30	0. 02
1, 192	600281	华阳新材	316, 800	1, 283, 040. 00	0. 02
1, 193	003025	思进智能	79, 095	1, 277, 384. 25	0. 02
1, 194	600398	海澜之家	185, 600	1, 276, 928. 00	0. 02
1, 195	603797	联泰环保	229, 240	1, 274, 574. 40	0. 02
1, 196	603021	山东华鹏	249, 100	1, 272, 901. 00	0. 02
1, 197	000758	中色股份	269, 100	1, 270, 152. 00	0. 02
1, 198	603102	百合股份	29, 400	1, 269, 786. 00	0. 02
1, 199	301309	万得凯	45, 984	1, 266, 399. 36	0. 02
1, 200	001211	双枪科技	57, 600	1, 263, 168. 00	0. 02
1, 201	600082	海泰发展	400, 900	1, 262, 835. 00	0. 02
1, 202	603995	甬金股份	52, 600	1, 257, 666. 00	0. 02
1, 203	600237	铜峰电子	152, 700	1, 256, 721. 00	0. 02
1, 204	300428	立中集团	54, 400	1, 254, 464. 00	0. 02
1, 205	603466	风语筑	90, 100	1, 252, 390. 00	0. 02
1, 206	603936	博敏电子	104, 200	1, 250, 400. 00	0. 02
1, 207	301028	东亚机械	111, 800	1, 246, 570. 00	0. 02
1, 208	600249	两面针	226, 100	1, 243, 550. 00	0. 02
1, 209	600195	中牧股份	106, 100	1, 239, 248. 00	0. 02
1, 210	000425	徐工机械	182, 200	1, 233, 494. 00	0. 02
1, 211	603048	浙江黎明	76, 000	1, 223, 600. 00	0. 02
1, 212	000545	金浦钛业	421, 100	1, 221, 190. 00	0. 02
1, 213	603650	彤程新材	37, 200	1, 220, 160. 00	0. 02
1, 214	300931	通用电梯	155, 400	1, 219, 890. 00	0. 02
1, 215	688560	明冠新材	43, 874	1, 219, 258. 46	0. 02
1, 216	300817	双飞股份	81, 540	1, 219, 023. 00	0. 02
1, 217	300572	安车检测	70, 200	1, 216, 566. 00	0. 02
1, 218	603979	金诚信	39, 100	1, 216, 010. 00	0. 02
1, 219	603181	皇马科技	109, 100	1, 215, 374. 00	0. 02
1, 220	603897	长城科技	60, 506	1, 213, 750. 36	0. 02
1, 221	002960	青鸟消防	66, 500	1, 210, 965. 00	0. 02
1, 222	300537	广信材料	74, 100	1, 210, 794. 00	0. 02
1, 223	300429	强力新材	120, 700	1, 209, 414. 00	0. 02
1, 224	300802	矩子科技	50, 100	1, 205, 907. 00	0. 02
1, 225	001267	汇绿生态	216, 000	1, 205, 280. 00	0. 02
1, 226	300063	天龙集团	277, 600	1, 202, 008. 00	0. 02

1,227	603366	日出东方	206,800	1,201,508.00	0.02
1,228	603022	新通联	127,600	1,200,716.00	0.02
1,229	300550	和仁科技	68,100	1,195,836.00	0.02
1,230	000949	新乡化纤	371,700	1,193,157.00	0.02
1,231	300566	激智科技	64,700	1,193,068.00	0.02
1,232	002468	申通快递	110,100	1,191,282.00	0.02
1,233	002631	德尔未来	220,200	1,189,080.00	0.02
1,234	300538	同益股份	68,300	1,185,005.00	0.02
1,235	002398	垒知集团	207,700	1,183,890.00	0.02
1,236	002476	宝莫股份	261,800	1,175,482.00	0.02
1,237	600101	明星电力	123,300	1,172,583.00	0.02
1,238	002304	洋河股份	8,900	1,169,015.00	0.02
1,239	002667	威领股份	69,500	1,166,210.00	0.02
1,240	603028	赛福天	98,400	1,163,088.00	0.02
1,241	000166	申万宏源	251,700	1,162,854.00	0.02
1,242	600018	上港集团	221,000	1,160,250.00	0.02
1,243	002141	贤丰控股	351,700	1,157,093.00	0.02
1,244	300789	唐源电气	56,100	1,156,782.00	0.02
1,245	001226	拓山重工	37,900	1,155,950.00	0.02
1,246	002933	新兴装备	39,200	1,151,304.00	0.02
1,247	603378	亚士创能	126,300	1,150,593.00	0.02
1,248	603978	深圳新星	64,800	1,150,200.00	0.02
1,249	300528	幸福蓝海	126,400	1,138,864.00	0.02
1,250	001965	招商公路	118,400	1,136,640.00	0.02
1,251	600834	申通地铁	138,100	1,136,563.00	0.02
1,252	002389	航天彩虹	51,100	1,134,931.00	0.02
1,253	000488	晨鸣纸业	233,300	1,131,505.00	0.02
1,254	600629	华建集团	161,700	1,128,666.00	0.02
1,255	002923	润都股份	82,740	1,126,091.40	0.02
1,256	002515	金字火腿	236,000	1,125,720.00	0.02
1,257	605566	福莱茵特	48,900	1,124,700.00	0.02
1,258	300952	恒辉安防	49,800	1,123,488.00	0.02
1,259	600262	北方股份	52,400	1,122,932.00	0.02
1,260	688571	杭华股份	177,631	1,120,851.61	0.02
1,261	603326	我乐家居	143,300	1,119,173.00	0.02
1,262	603365	水星家纺	79,300	1,114,958.00	0.02
1,263	605060	联德股份	40,500	1,112,130.00	0.02
1,264	000679	大连友谊	225,200	1,110,236.00	0.02
1,265	600798	宁波海运	315,400	1,107,054.00	0.02
1,266	001206	依依股份	74,792	1,106,921.60	0.02
1,267	603639	海利尔	61,300	1,098,496.00	0.02
1,268	002169	智光电气	132,505	1,098,466.45	0.02
1,269	002331	皖通科技	160,500	1,096,215.00	0.02

1,270	002434	万里扬	122,400	1,095,480.00	0.02
1,271	300632	光莆股份	85,400	1,091,412.00	0.02
1,272	002012	凯恩股份	167,300	1,089,123.00	0.02
1,273	600649	城投控股	276,700	1,087,431.00	0.02
1,274	603085	天成自控	109,000	1,083,460.00	0.02
1,275	600851	海欣股份	187,000	1,080,860.00	0.02
1,276	002280	联络互动	330,000	1,079,100.00	0.02
1,277	601003	柳钢股份	266,700	1,077,468.00	0.02
1,278	603505	金石资源	46,100	1,076,435.00	0.02
1,279	002922	伊戈尔	74,556	1,069,878.60	0.02
1,280	002759	天际股份	76,400	1,068,072.00	0.02
1,281	605259	绿田机械	27,400	1,063,668.00	0.02
1,282	002346	柘中股份	85,400	1,062,376.00	0.02
1,283	300992	泰福泵业	52,700	1,060,324.00	0.02
1,284	300190	维尔利	263,700	1,052,163.00	0.02
1,285	603908	牧高笛	21,700	1,051,582.00	0.02
1,286	603390	通达电气	124,400	1,044,960.00	0.02
1,287	002996	顺博合金	85,800	1,038,180.00	0.02
1,288	603103	横店影视	61,200	1,030,608.00	0.02
1,289	603003	龙宇股份	106,800	1,019,940.00	0.02
1,290	301081	严牌股份	101,249	1,007,427.55	0.02
1,291	603131	上海沪工	80,500	1,007,055.00	0.02
1,292	600630	龙头股份	175,400	1,003,288.00	0.02
1,293	002245	蔚蓝锂芯	91,400	1,000,830.00	0.02
1,294	600107	美尔雅	186,100	999,357.00	0.02
1,295	600962	国投中鲁	83,400	995,796.00	0.02
1,296	000555	神州信息	80,700	992,610.00	0.02
1,297	300575	中旗股份	95,500	991,290.00	0.02
1,298	002279	久其软件	153,900	989,577.00	0.02
1,299	002853	皮阿诺	57,000	986,100.00	0.02
1,300	605169	洪通燃气	95,600	981,812.00	0.02
1,301	002963	豪尔赛	67,300	979,215.00	0.02
1,302	603885	吉祥航空	63,100	973,633.00	0.02
1,303	001256	炜冈科技	52,900	973,360.00	0.02
1,304	300152	新动力	336,900	970,272.00	0.02
1,305	600604	市北高新	206,900	968,292.00	0.02
1,306	300607	拓斯达	64,300	966,429.00	0.02
1,307	300658	延江股份	147,320	964,946.00	0.02
1,308	601326	秦港股份	284,200	960,596.00	0.02
1,309	300691	联合光电	54,500	960,290.00	0.02
1,310	603112	华翔股份	81,400	957,264.00	0.02
1,311	000159	国际实业	134,600	955,660.00	0.02
1,312	600865	百大集团	111,342	954,200.94	0.02

1,313	600846	同济科技	84,900	950,880.00	0.02
1,314	600497	驰宏锌锗	189,300	950,286.00	0.02
1,315	002308	威创股份	200,500	944,355.00	0.02
1,316	002158	汉钟精机	37,700	940,992.00	0.02
1,317	600279	重庆港	226,100	940,576.00	0.02
1,318	300927	江天化学	57,300	938,001.00	0.02
1,319	603739	蔚蓝生物	71,400	936,054.00	0.02
1,320	601126	四方股份	61,600	935,704.00	0.02
1,321	605368	蓝天燃气	96,900	927,333.00	0.01
1,322	300870	欧陆通	15,400	922,922.00	0.01
1,323	605218	伟时电子	59,300	919,150.00	0.01
1,324	000558	莱茵体育	303,300	918,999.00	0.01
1,325	003023	彩虹集团	44,500	912,695.00	0.01
1,326	300970	华绿生物	38,900	908,704.00	0.01
1,327	603856	东宏股份	68,400	902,196.00	0.01
1,328	603968	醋化股份	50,700	900,432.00	0.01
1,329	300517	海波重科	65,000	899,600.00	0.01
1,330	600638	新黄浦	169,200	895,068.00	0.01
1,331	603069	海汽集团	47,100	886,893.00	0.01
1,332	003016	欣贺股份	87,800	886,780.00	0.01
1,333	600467	好当家	363,700	880,154.00	0.01
1,334	603150	万朗磁塑	33,300	877,788.00	0.01
1,335	300314	戴维医疗	41,300	873,082.00	0.01
1,336	600333	长春燃气	178,900	873,032.00	0.01
1,337	600054	黄山旅游	67,700	866,560.00	0.01
1,338	003001	中岩大地	52,600	861,588.00	0.01
1,339	600619	海立股份	131,700	854,733.00	0.01
1,340	688588	凌志软件	54,774	851,735.70	0.01
1,341	688681	科汇股份	52,696	851,567.36	0.01
1,342	600151	航天机电	94,700	843,777.00	0.01
1,343	301280	珠城科技	23,550	842,148.00	0.01
1,344	300211	亿通科技	82,800	832,140.00	0.01
1,345	300072	海新能科	242,700	830,034.00	0.01
1,346	300958	建工修复	46,600	826,684.00	0.01
1,347	300449	汉邦高科	123,200	821,744.00	0.01
1,348	600826	兰生股份	79,600	817,492.00	0.01
1,349	603013	亚普股份	51,900	813,792.00	0.01
1,350	000715	中兴商业	109,100	806,249.00	0.01
1,351	601106	中国一重	239,800	805,728.00	0.01
1,352	002825	纳尔股份	64,200	800,574.00	0.01
1,353	603536	惠发食品	123,900	797,916.00	0.01
1,354	000877	天山股份	98,000	797,720.00	0.01
1,355	300947	德必集团	54,500	795,155.00	0.01

1,356	001368	通达创智	31,200	793,104.00	0.01
1,357	301335	天元宠物	33,193	791,321.12	0.01
1,358	002342	巨力索具	192,800	790,480.00	0.01
1,359	603096	新经典	38,800	789,968.00	0.01
1,360	002973	侨银股份	68,100	789,960.00	0.01
1,361	600897	厦门空港	37,900	784,151.00	0.01
1,362	301176	逸豪新材	45,600	783,408.00	0.01
1,363	603587	地素时尚	53,320	780,604.80	0.01
1,364	300849	锦盛新材	71,500	776,490.00	0.01
1,365	000777	中核科技	57,500	775,675.00	0.01
1,366	603323	苏农银行	183,900	774,219.00	0.01
1,367	002196	方正电机	109,570	771,372.80	0.01
1,368	605136	丽人丽妆	66,500	766,745.00	0.01
1,369	600076	康欣新材	298,100	766,117.00	0.01
1,370	600477	杭萧钢构	185,700	759,513.00	0.01
1,371	002839	张家港行	179,400	758,862.00	0.01
1,372	002520	日发精机	122,700	758,286.00	0.01
1,373	300791	仙乐健康	26,100	757,944.00	0.01
1,374	600992	贵绳股份	42,100	756,958.00	0.01
1,375	300837	浙矿股份	19,700	756,480.00	0.01
1,376	603886	元祖股份	41,200	755,608.00	0.01
1,377	000685	中山公用	99,400	752,458.00	0.01
1,378	300532	今天国际	36,500	750,440.00	0.01
1,379	002799	环球印务	67,100	748,165.00	0.01
1,380	002225	濮耐股份	197,600	746,928.00	0.01
1,381	605020	永和股份	28,880	745,392.80	0.01
1,382	600874	创业环保	127,200	745,392.00	0.01
1,383	002900	哈三联	55,400	740,698.00	0.01
1,384	301209	联合化学	30,100	740,159.00	0.01
1,385	003005	竞业达	24,100	739,629.00	0.01
1,386	002278	神开股份	138,700	739,271.00	0.01
1,387	002649	博彦科技	52,300	738,999.00	0.01
1,388	601200	上海环境	77,700	737,373.00	0.01
1,389	601969	海南矿业	111,900	736,302.00	0.01
1,390	301160	翔楼新材	20,792	730,838.80	0.01
1,391	300246	宝莱特	58,700	730,815.00	0.01
1,392	300135	宝利国际	268,600	730,592.00	0.01
1,393	603306	华懋科技	25,000	725,500.00	0.01
1,394	600648	外高桥	64,100	724,971.00	0.01
1,395	002674	兴业科技	58,500	722,475.00	0.01
1,396	000882	华联股份	440,300	722,092.00	0.01
1,397	300069	金利华电	52,900	721,556.00	0.01
1,398	000603	盛达资源	59,400	718,146.00	0.01

1,399	603171	税友股份	17,900	715,642.00	0.01
1,400	300735	光弘科技	66,500	711,550.00	0.01
1,401	002967	广电计量	35,400	711,186.00	0.01
1,402	300826	测绘股份	44,300	709,686.00	0.01
1,403	605081	太和水	47,000	699,830.00	0.01
1,404	300871	回盛生物	42,100	693,808.00	0.01
1,405	000557	西部创业	131,000	690,370.00	0.01
1,406	603822	嘉澳环保	21,200	690,060.00	0.01
1,407	301037	保立佳	38,600	687,852.00	0.01
1,408	603329	上海雅仕	51,500	682,375.00	0.01
1,409	002910	庄园牧场	61,600	677,600.00	0.01
1,410	300295	三六五网	54,700	676,639.00	0.01
1,411	000829	天音控股	74,800	676,192.00	0.01
1,412	301237	和顺科技	22,700	673,963.00	0.01
1,413	601116	三江购物	58,900	670,871.00	0.01
1,414	603067	振华股份	55,100	669,465.00	0.01
1,415	000050	深天马 A	72,800	668,304.00	0.01
1,416	300993	玉马遮阳	58,132	665,611.40	0.01
1,417	603909	建发合诚	49,822	664,127.26	0.01
1,418	002683	广东宏大	22,400	659,456.00	0.01
1,419	603595	东尼电子	15,200	650,864.00	0.01
1,420	002320	海峡股份	106,600	643,864.00	0.01
1,421	002454	松芝股份	75,700	641,179.00	0.01
1,422	003007	直真科技	24,700	637,013.00	0.01
1,423	605288	凯迪股份	14,500	624,080.00	0.01
1,424	000537	广宇发展	53,300	622,011.00	0.01
1,425	600006	东风汽车	103,700	612,867.00	0.01
1,426	002016	世荣兆业	92,000	612,720.00	0.01
1,427	300461	田中精机	24,700	612,313.00	0.01
1,428	002658	雪迪龙	75,000	609,750.00	0.01
1,429	300980	祥源新材	30,000	603,300.00	0.01
1,430	603636	南威软件	41,000	601,470.00	0.01
1,431	000401	冀东水泥	81,525	600,839.25	0.01
1,432	002763	汇洁股份	67,300	596,278.00	0.01
1,433	600626	申达股份	171,400	591,330.00	0.01
1,434	601007	金陵饭店	68,900	587,028.00	0.01
1,435	603955	大千生态	38,600	586,720.00	0.01
1,436	002440	闰土股份	87,400	582,958.00	0.01
1,437	300364	中文在线	32,600	580,932.00	0.01
1,438	600739	辽宁成大	43,964	578,126.60	0.01
1,439	301131	聚赛龙	14,300	574,574.00	0.01
1,440	300196	长海股份	41,400	573,390.00	0.01
1,441	688109	品茗科技	22,094	572,234.60	0.01

1,442	002980	华盛昌	16,900	565,474.00	0.01
1,443	601939	建设银行	90,300	565,278.00	0.01
1,444	300988	津荣天宇	26,200	562,776.00	0.01
1,445	300396	迪瑞医疗	17,300	562,077.00	0.01
1,446	600926	杭州银行	47,800	561,650.00	0.01
1,447	605108	同庆楼	16,800	561,120.00	0.01
1,448	300239	东宝生物	90,800	559,328.00	0.01
1,449	002641	公元股份	99,000	558,360.00	0.01
1,450	002917	金奥博	44,900	554,964.00	0.01
1,451	603192	汇得科技	29,070	554,946.30	0.01
1,452	000881	中广核技	67,300	553,879.00	0.01
1,453	002741	光华科技	32,800	553,664.00	0.01
1,454	600714	金瑞矿业	58,600	549,082.00	0.01
1,455	600461	洪城环境	67,200	549,024.00	0.01
1,456	002549	凯美特气	47,500	546,250.00	0.01
1,457	301079	邵阳液压	25,500	543,660.00	0.01
1,458	301065	本立科技	26,000	537,940.00	0.01
1,459	000955	欣龙控股	124,000	534,440.00	0.01
1,460	000619	海螺新材	87,500	533,750.00	0.01
1,461	603200	上海洗霸	25,600	533,248.00	0.01
1,462	300065	海兰信	42,900	531,531.00	0.01
1,463	002862	实丰文化	28,200	531,288.00	0.01
1,464	002895	川恒股份	26,900	529,930.00	0.01
1,465	603182	嘉华股份	35,000	529,200.00	0.01
1,466	603058	永吉股份	54,200	528,450.00	0.01
1,467	300011	鼎汉技术	71,700	527,712.00	0.01
1,468	301319	唯特偶	8,800	526,680.00	0.01
1,469	600985	淮北矿业	45,400	523,008.00	0.01
1,470	002976	瑞玛精密	18,600	520,242.00	0.01
1,471	603992	松霖科技	33,900	520,026.00	0.01
1,472	002480	新筑股份	110,900	519,012.00	0.01
1,473	688669	聚石化学	28,394	514,783.22	0.01
1,474	300852	四会富仕	12,300	509,958.00	0.01
1,475	002214	大立科技	37,300	509,145.00	0.01
1,476	601328	交通银行	87,700	508,660.00	0.01
1,477	002789	建艺集团	35,000	508,550.00	0.01
1,478	301148	嘉戎技术	23,700	506,706.00	0.01
1,479	688179	阿拉丁	16,849	503,111.14	0.01
1,480	300815	玉禾田	33,600	499,968.00	0.01
1,481	300843	胜蓝股份	23,300	496,989.00	0.01
1,482	002857	三晖电气	25,000	493,750.00	0.01
1,483	600857	宁波中百	49,700	492,030.00	0.01
1,484	300653	正海生物	14,300	491,777.00	0.01

1,485	603055	台华新材	43,900	487,729.00	0.01
1,486	300084	海默科技	77,600	485,000.00	0.01
1,487	688181	八亿时空	17,145	483,317.55	0.01
1,488	603527	众源新材	39,500	482,690.00	0.01
1,489	300933	中辰股份	61,700	475,090.00	0.01
1,490	002678	珠江钢琴	82,200	471,006.00	0.01
1,491	300829	金丹科技	22,500	470,925.00	0.01
1,492	603500	祥和实业	34,300	470,596.00	0.01
1,493	002429	兆驰股份	85,300	469,150.00	0.01
1,494	601872	招商轮船	81,000	468,990.00	0.01
1,495	603580	艾艾精工	32,300	459,629.00	0.01
1,496	603619	中曼石油	27,100	458,532.00	0.01
1,497	600399	抚顺特钢	44,800	456,960.00	0.01
1,498	603708	家家悦	36,000	451,440.00	0.01
1,499	688067	爱威科技	20,428	449,416.00	0.01
1,500	000926	福星股份	107,200	448,096.00	0.01
1,501	603309	维力医疗	28,700	443,989.00	0.01
1,502	603313	梦百合	44,200	443,326.00	0.01
1,503	600530	交大昂立	177,300	441,477.00	0.01
1,504	300959	线上线下	12,200	438,712.00	0.01
1,505	301231	荣信文化	13,000	437,320.00	0.01
1,506	603929	亚翔集成	25,500	428,400.00	0.01
1,507	300978	东箭科技	31,400	427,982.00	0.01
1,508	601311	骆驼股份	46,000	426,880.00	0.01
1,509	603206	嘉环科技	24,600	424,350.00	0.01
1,510	002646	天佑德酒	31,100	419,539.00	0.01
1,511	300290	荣科科技	87,345	419,256.00	0.01
1,512	002884	凌霄泵业	27,400	417,850.00	0.01
1,513	000534	万泽股份	24,500	410,865.00	0.01
1,514	002946	新乳业	28,600	410,410.00	0.01
1,515	688518	联赢激光	14,648	408,093.28	0.01
1,516	002054	德美化工	58,400	407,632.00	0.01
1,517	002731	萃华珠宝	28,500	406,695.00	0.01
1,518	603969	银龙股份	87,500	404,250.00	0.01
1,519	000657	中钨高新	41,700	404,073.00	0.01
1,520	688509	正元地信	81,091	403,022.27	0.01
1,521	001230	劲旅环境	16,328	400,199.28	0.01
1,522	600159	大龙地产	146,800	394,892.00	0.01
1,523	600819	耀皮玻璃	80,200	393,782.00	0.01
1,524	003040	楚天龙	21,400	388,196.00	0.01
1,525	300424	航新科技	26,400	387,552.00	0.01
1,526	300368	汇金股份	58,300	387,112.00	0.01
1,527	000612	焦作万方	79,600	385,264.00	0.01

1,528	000703	恒逸石化	56,300	381,714.00	0.01
1,529	002778	中晟高科	26,000	377,520.00	0.01
1,530	300464	星徽股份	56,500	376,855.00	0.01
1,531	601222	林洋能源	46,000	376,740.00	0.01
1,532	301005	超捷股份	13,100	374,660.00	0.01
1,533	600936	广西广电	97,800	374,574.00	0.01
1,534	603217	元利科技	14,500	373,375.00	0.01
1,535	300452	山河药辅	21,400	373,216.00	0.01
1,536	301115	建科股份	16,200	370,332.00	0.01
1,537	600168	武汉控股	61,500	369,615.00	0.01
1,538	002357	富临运业	54,200	364,224.00	0.01
1,539	002981	朝阳科技	15,100	363,910.00	0.01
1,540	600287	江苏舜天	71,000	362,810.00	0.01
1,541	600712	南宁百货	97,400	361,354.00	0.01
1,542	003013	地铁设计	19,800	361,350.00	0.01
1,543	003020	立方制药	9,700	358,997.00	0.01
1,544	002790	瑞尔特	37,200	357,120.00	0.01
1,545	300881	盛德鑫泰	10,800	355,860.00	0.01
1,546	002988	豪美新材	20,800	355,472.00	0.01
1,547	301016	雷尔伟	17,500	351,050.00	0.01
1,548	603518	锦泓集团	30,800	349,580.00	0.01
1,549	601686	友发集团	50,800	347,472.00	0.01
1,550	600770	综艺股份	60,900	342,867.00	0.01
1,551	300915	海融科技	9,200	341,596.00	0.01
1,552	003026	中晶科技	8,600	338,238.00	0.01
1,553	688216	气派科技	12,771	329,108.67	0.01
1,554	605378	野马电池	14,000	326,340.00	0.01
1,555	000663	永安林业	26,200	319,116.00	0.01
1,556	600075	新疆天业	67,100	316,041.00	0.01
1,557	301188	力诺特玻	18,400	314,272.00	0.01
1,558	301197	工大科雅	13,000	313,300.00	0.01
1,559	603766	隆鑫通用	58,600	309,408.00	0.00
1,560	000785	居然之家	80,800	307,848.00	0.00
1,561	688007	光峰科技	14,662	305,702.70	0.00
1,562	688101	三达膜	22,731	303,231.54	0.00
1,563	301288	清研环境	17,500	302,050.00	0.00
1,564	301339	通行宝	12,000	301,560.00	0.00
1,565	000789	万年青	38,800	300,700.00	0.00
1,566	000791	甘肃能源	57,200	299,156.00	0.00
1,567	301056	森赫股份	32,500	297,700.00	0.00
1,568	600650	锦江在线	30,700	294,106.00	0.00
1,569	688508	芯朋微	5,053	293,023.47	0.00
1,570	600778	友好集团	42,500	289,000.00	0.00

1,571	688021	奥福环保	11,072	286,986.24	0.00
1,572	603043	广州酒家	10,100	285,426.00	0.00
1,573	301228	实朴检测	18,300	285,114.00	0.00
1,574	301019	宁波色母	13,800	284,832.00	0.00
1,575	002637	赞宇科技	27,600	284,556.00	0.00
1,576	603123	翠微股份	29,200	284,408.00	0.00
1,577	000529	广弘控股	43,700	277,932.00	0.00
1,578	002663	普邦股份	150,800	277,472.00	0.00
1,579	002724	海洋王	31,700	275,156.00	0.00
1,580	300656	民德电子	8,800	274,032.00	0.00
1,581	600193	创兴资源	51,400	269,850.00	0.00
1,582	002358	森源电气	59,000	269,630.00	0.00
1,583	603214	爱婴室	16,400	266,828.00	0.00
1,584	600817	宇通重工	23,800	266,322.00	0.00
1,585	300355	蒙草生态	76,300	266,287.00	0.00
1,586	002242	九阳股份	17,700	264,615.00	0.00
1,587	300893	松原股份	10,200	262,446.00	0.00
1,588	605018	长华集团	24,500	258,965.00	0.00
1,589	000011	深物业 A	27,800	258,262.00	0.00
1,590	300157	恒泰艾普	79,200	255,024.00	0.00
1,591	300891	惠云钛业	27,900	255,006.00	0.00
1,592	605255	天普股份	16,000	252,800.00	0.00
1,593	600280	中央商场	97,900	252,582.00	0.00
1,594	603035	常熟汽饰	12,900	250,647.00	0.00
1,595	000731	四川美丰	30,600	249,390.00	0.00
1,596	600802	福建水泥	50,500	248,965.00	0.00
1,597	605001	威奥股份	35,500	248,145.00	0.00
1,598	002860	星帅尔	18,300	246,684.00	0.00
1,599	000672	上峰水泥	26,900	245,597.00	0.00
1,600	603901	永创智能	16,700	243,152.00	0.00
1,601	000058	深赛格	39,200	242,256.00	0.00
1,602	001212	中旗新材	9,800	241,962.00	0.00
1,603	605158	华达新材	31,800	241,680.00	0.00
1,604	688227	品高股份	9,657	239,783.31	0.00
1,605	300187	永清环保	40,500	235,710.00	0.00
1,606	301265	华新环保	20,200	234,724.00	0.00
1,607	000426	兴业银锡	26,300	233,544.00	0.00
1,608	601828	美凯龙	48,540	232,506.60	0.00
1,609	301077	星华新材	10,800	231,444.00	0.00
1,610	000668	荣丰控股	19,900	230,840.00	0.00
1,611	002327	富安娜	27,400	230,708.00	0.00
1,612	688722	同益中	12,377	229,469.58	0.00
1,613	002314	南山控股	69,400	229,020.00	0.00

1,614	300412	迦南科技	38,500	228,305.00	0.00
1,615	002203	海亮股份	19,000	228,190.00	0.00
1,616	300160	秀强股份	34,800	225,852.00	0.00
1,617	600405	动力源	38,300	225,587.00	0.00
1,618	002898	赛隆药业	19,600	221,872.00	0.00
1,619	300422	博世科	36,600	219,966.00	0.00
1,620	300833	浩洋股份	2,000	218,860.00	0.00
1,621	605303	园林股份	19,400	215,340.00	0.00
1,622	601798	蓝科高新	28,100	213,279.00	0.00
1,623	002693	双成药业	35,000	210,700.00	0.00
1,624	001330	博纳影业	22,500	208,800.00	0.00
1,625	601330	绿色动力	28,100	207,659.00	0.00
1,626	603922	金鸿顺	9,100	205,478.00	0.00
1,627	000931	中关村	35,360	203,673.60	0.00
1,628	600801	华新水泥	16,100	198,835.00	0.00
1,629	300961	深水海纳	18,400	198,168.00	0.00
1,630	300174	元力股份	12,500	197,125.00	0.00
1,631	603010	万盛股份	18,000	195,660.00	0.00
1,632	301259	艾布鲁	14,540	195,563.00	0.00
1,633	603836	海程邦达	12,600	193,662.00	0.00
1,634	300206	理邦仪器	12,800	193,024.00	0.00
1,635	300214	日科化学	30,800	191,268.00	0.00
1,636	603516	淳中科技	8,600	189,630.00	0.00
1,637	002318	久立特材	11,000	187,330.00	0.00
1,638	603230	内蒙新华	14,400	185,760.00	0.00
1,639	002735	王子新材	13,260	184,977.00	0.00
1,640	600838	上海九百	28,900	184,671.00	0.00
1,641	300320	海达股份	23,100	180,873.00	0.00
1,642	605005	合兴股份	11,300	178,879.00	0.00
1,643	301092	争光股份	6,800	178,024.00	0.00
1,644	601011	宝泰隆	49,300	176,987.00	0.00
1,645	300145	中金环境	59,900	176,106.00	0.00
1,646	603755	日辰股份	5,600	175,784.00	0.00
1,647	605228	神通科技	18,000	172,260.00	0.00
1,648	603985	恒润股份	8,077	169,374.69	0.00
1,649	000639	西王食品	35,500	162,945.00	0.00
1,650	600080	金花股份	22,100	162,656.00	0.00
1,651	000550	江铃汽车	11,500	159,160.00	0.00
1,652	301349	信德新材	3,100	155,434.00	0.00
1,653	600008	首创环保	51,200	147,456.00	0.00
1,654	600272	开开实业	16,300	147,189.00	0.00
1,655	002306	中科云网	33,800	142,298.00	0.00
1,656	605376	博迁新材	4,400	138,072.00	0.00

1,657	300105	龙源技术	20,500	137,555.00	0.00
1,658	002378	章源钨业	23,600	137,352.00	0.00
1,659	000566	海南海药	27,400	137,000.00	0.00
1,660	002419	天虹股份	23,300	136,305.00	0.00
1,661	688249	C 晶合	7,405	133,734.30	0.00
1,662	603016	新宏泰	5,700	132,411.00	0.00
1,663	002891	中宠股份	5,400	130,356.00	0.00
1,664	000045	深纺织 A	11,600	127,600.00	0.00
1,665	603819	神力股份	7,600	126,768.00	0.00
1,666	002216	三全食品	8,000	124,640.00	0.00
1,667	300092	科新机电	7,500	123,000.00	0.00
1,668	301220	亚香股份	3,600	122,796.00	0.00
1,669	605399	晨光新材	6,680	118,904.00	0.00
1,670	603136	天目湖	4,600	118,680.00	0.00
1,671	000852	石化机械	16,300	117,197.00	0.00
1,672	002888	惠威科技	7,700	116,193.00	0.00
1,673	600603	广汇物流	15,600	108,576.00	0.00
1,674	002719	麦趣尔	11,700	107,640.00	0.00
1,675	301135	瑞德智能	3,900	106,938.00	0.00
1,676	603201	常润股份	4,660	106,853.80	0.00
1,677	600491	龙元建设	20,600	103,824.00	0.00
1,678	605366	宏柏新材	10,800	101,628.00	0.00
1,679	000528	柳 工	12,800	101,120.00	0.00
1,680	300966	共同药业	4,500	100,575.00	0.00
1,681	002333	罗普斯金	16,500	99,825.00	0.00
1,682	603280	南方路机	4,000	98,320.00	0.00
1,683	003043	华亚智能	1,700	95,999.00	0.00
1,684	688168	安博通	2,622	93,343.20	0.00
1,685	603956	威派格	11,600	92,684.00	0.00
1,686	001260	坤泰股份	4,242	91,160.58	0.00
1,687	603948	建业股份	4,200	90,300.00	0.00
1,688	000031	大悦城	24,600	90,036.00	0.00
1,689	600371	万向德农	7,300	84,388.00	0.00
1,690	002469	三维化学	13,700	84,255.00	0.00
1,691	001222	源飞宠物	5,540	83,820.20	0.00
1,692	002498	汉缆股份	20,200	81,002.00	0.00
1,693	603212	赛伍技术	3,700	76,997.00	0.00
1,694	300409	道氏技术	6,100	76,677.00	0.00
1,695	603203	快克智能	2,400	73,872.00	0.00
1,696	002677	浙江美大	6,800	72,012.00	0.00
1,697	000430	张家界	9,200	71,300.00	0.00
1,698	600783	鲁信创投	5,500	71,115.00	0.00
1,699	600167	联美控股	10,100	70,397.00	0.00

1,700	603511	爱慕股份	3,700	63,640.00	0.00
1,701	301075	多瑞医药	2,600	62,530.00	0.00
1,702	301193	家联科技	3,500	61,355.00	0.00
1,703	300331	苏大维格	2,300	60,076.00	0.00
1,704	000633	合金投资	8,600	59,168.00	0.00
1,705	002748	世龙实业	6,100	55,754.00	0.00
1,706	002779	中坚科技	2,100	55,251.00	0.00
1,707	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
1,708	688443	智翔金泰	1,794	52,905.06	0.00
1,709	688616	西力科技	3,740	49,480.20	0.00
1,710	000514	渝开发	12,700	48,514.00	0.00
1,711	002769	普路通	5,800	46,284.00	0.00
1,712	300577	开润股份	2,800	45,612.00	0.00
1,713	300948	冠中生态	3,000	45,330.00	0.00
1,714	600824	益民集团	12,600	44,856.00	0.00
1,715	000017	深中华 A	10,300	44,496.00	0.00
1,716	600827	百联股份	3,100	41,447.00	0.00
1,717	300180	华峰超纤	11,000	39,710.00	0.00
1,718	603098	森特股份	1,900	38,950.00	0.00
1,719	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
1,720	600727	鲁北化工	6,700	38,190.00	0.00
1,721	301105	鸿铭股份	1,000	37,000.00	0.00
1,722	001202	炬申股份	2,100	30,996.00	0.00
1,723	600716	凤凰股份	8,000	30,240.00	0.00
1,724	002978	安宁股份	900	28,899.00	0.00
1,725	600207	安彩高科	4,200	25,326.00	0.00
1,726	300700	岱勒新材	1,320	25,146.00	0.00
1,727	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
1,728	000048	京基智农	1,200	23,424.00	0.00
1,729	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
1,730	301108	洁雅股份	600	21,720.00	0.00
1,731	600177	雅戈尔	3,200	20,192.00	0.00
1,732	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
1,733	300523	辰安科技	800	19,088.00	0.00
1,734	688096	京源环保	1,927	18,961.68	0.00
1,735	688175	高凌信息	513	16,990.56	0.00
1,736	600681	百川能源	3,400	15,878.00	0.00
1,737	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
1,738	002690	美亚光电	500	12,875.00	0.00
1,739	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
1,740	002328	新朋股份	600	3,672.00	0.00
1,741	603811	诚意药业	280	3,480.40	0.00
1,742	000831	中国稀土	100	2,960.00	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	601318	中国平安	143,271,501.48	6.52
2	300033	同花顺	103,889,626.75	4.73
3	601668	中国建筑	98,363,072.81	4.48
4	002463	沪电股份	87,309,094.50	3.97
5	002466	天齐锂业	68,422,578.62	3.11
6	601688	华泰证券	60,287,157.40	2.74
7	601186	中国铁建	55,934,353.00	2.54
8	600584	长电科技	53,558,770.00	2.44
9	601618	中国中冶	53,375,590.61	2.43
10	600030	中信证券	51,470,671.80	2.34
11	002415	海康威视	49,288,504.25	2.24
12	600028	中国石化	47,272,735.00	2.15
13	300223	北京君正	41,077,105.64	1.87
14	688390	固德威	40,757,240.62	1.85
15	601868	中国能建	39,515,900.00	1.80
16	600958	东方证券	38,349,812.48	1.74
17	603501	韦尔股份	36,691,808.13	1.67
18	300750	宁德时代	36,220,015.00	1.65
19	002236	大华股份	36,193,321.95	1.65
20	300014	亿纬锂能	34,508,447.50	1.57

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	601318	中国平安	139,309,912.76	6.34
2	002463	沪电股份	97,524,691.53	4.44
3	300033	同花顺	94,247,904.81	4.29
4	601668	中国建筑	87,079,350.68	3.96
5	002466	天齐锂业	63,994,387.80	2.91
6	601688	华泰证券	53,863,913.55	2.45
7	601186	中国铁建	53,625,819.00	2.44
8	600030	中信证券	50,837,975.60	2.31
9	002415	海康威视	47,045,903.72	2.14
10	300750	宁德时代	46,713,613.80	2.13
11	600584	长电科技	46,002,052.69	2.09
12	002475	立讯精密	40,993,080.00	1.87

13	603501	韦尔股份	40,553,151.11	1.85
14	601519	大智慧	38,588,673.00	1.76
15	601868	中国能建	38,393,223.20	1.75
16	300223	北京君正	37,945,732.08	1.73
17	002236	大华股份	37,737,633.00	1.72
18	000776	广发证券	36,864,334.20	1.68
19	688390	固德威	35,739,685.33	1.63
20	300014	亿纬锂能	35,683,040.24	1.62

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	18,465,410,009.61
卖出股票收入（成交）总额	14,958,268,346.42

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，新兴铸管股份有限公司于 2022 年 09 月 07 日受到益阳市发展和改革委员会给予 3.25 万元罚款的行政处罚；陕西省国际信托股份有限公司于 2022 年 08 月 17 日受到陕西银保监局给予罚款 162 万元的行政处罚；财通证券股份有限公司于 2022 年 11 月 30 日受到国家外汇管理局给予罚款 14 万元的行政处罚。

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是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	2,957,942.82
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,003,321.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,961,264.80

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

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
国金量化 多因子 A	174,742	11,347.50	662,635,776.62	33.42	1,320,248,972.66	66.58
国金量化 多因子 C	47,326	21,550.67	579,410,079.45	56.81	440,496,983.04	43.19
合计	222,068	13,521.95	1,242,045,856.07	41.36	1,760,745,955.70	58.64

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国金量化多因子 A	2,496,957.56	0.1259
	国金量化多因子 C	391,084.71	0.0383
	合计	2,888,042.27	0.0962

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情况

项目	份额级别	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	国金量化多因子 A	>100
	国金量化多因子 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国金量化多因子 A	50~100
	国金量化多因子 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
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	853,060,173.35	339,632,067.14
本报告期基金总申购 份额	2,058,485,578.14	1,446,020,160.21
减：本报告期基金总 赎回份额	928,661,002.21	765,745,164.86
本报告期基金拆分变	-	-

动份额		
本报告期末基金份额总额	1,982,884,749.28	1,019,907,062.49

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

原督察长张丽女士自 2023 年 6 月 14 日起由于个人原因离任基金管理人督察长职务，自 2023 年 6 月 14 日至 2023 年 7 月 23 日由公司总经理邵海波先生代任督察长职务，张静女士自 2023 年 7 月 24 日起担任基金管理人督察长职务。

除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内未有投资策略改变。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
山西证券	1	4,685,150,075.86	14.02	2,020,696.28	14.02	-
国新证券	2	4,666,834,391.99	13.96	2,012,785.06	13.96	-
国泰君安证券	2	3,604,821,768.49	10.79	1,554,769.85	10.79	-
广发证券	2	3,159,239,039.70	9.45	1,362,591.74	9.45	-
华泰证券	2	2,450,553,382.76	7.33	1,056,951.75	7.33	-
招商证券	2	2,032,175,074.45	6.08	876,483.14	6.08	-
天风证券	1	1,882,555,196.40	5.63	811,937.84	5.63	-
东方财富证券	1	1,421,809,736.36	4.25	613,220.42	4.25	-
中信证券	2	1,362,403,257.01	4.08	587,602.96	4.08	-
华创证券	1	1,297,180,527.16	3.88	559,483.63	3.88	-
长城证券	1	1,171,031,360.40	3.50	505,068.72	3.50	-
长江证券	2	1,155,345,633.93	3.46	498,305.86	3.46	-
信达证券	1	895,925,112.86	2.68	386,415.21	2.68	-
恒泰证券	1	895,441,572.28	2.68	386,205.77	2.68	-
中信建投证券	2	783,849,147.39	2.35	338,070.29	2.35	-
东兴证券	1	645,748,391.87	1.93	278,513.78	1.93	-
兴业证券	1	581,780,488.28	1.74	250,920.28	1.74	-
英大证券	1	396,703,307.46	1.19	171,098.42	1.19	-
第一创业证券	2	217,256,698.22	0.65	93,704.20	0.65	-
华福证券	1	113,987,220.02	0.34	49,164.73	0.34	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	1	-	-	-	-	-

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

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

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

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

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

2. 本基金本报告期新增国新证券、广发证券、华泰证券、方正证券、长江证券、国信证券、江海证券、华福证券、中信证券、德邦证券、华创证券、首创证券、方正证券、平安证券、江海证券、中国中金财富证券、第一创业证券、平安证券、天风证券、中信建投证券、兴业证券、恒泰证券共 28 个交易单元。

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(%)
山西证	-	-	12,794,000.0	39.20	-	-

券			00.00			
国新证 券	-	-	4,175,300,00 0.00	12.79	-	-
国泰君 安证券	-	-	2,030,800,00 0.00	6.22	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	847,200,000. 00	2.60	-	-
天风证 券	-	-	2,855,600,00 0.00	8.75	-	-
东方财 富证券	-	-	2,205,400,00 0.00	6.76	-	-
中信证 券	-	-	312,400,000. 00	0.96	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	1,980,100,00 0.00	6.07	-	-
信达证 券	-	-	1,308,800,00 0.00	4.01	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	886,400,000. 00	2.72	-	-
东兴证 券	-	-	2,428,600,00 0.00	7.44	-	-
兴业证 券	-	-	809,700,000. 00	2.48	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-

券						
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 05 日
2	《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	2023 年 01 月 06 日
3	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 A 类份额）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	2023 年 01 月 06 日
4	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 C 类份额）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	2023 年 01 月 06 日
5	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
6	《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	2023 年 02 月 27 日
7	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 A 类份额）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	2023 年 02 月 27 日
8	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 C 类份额）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	2023 年 02 月 27 日
9	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金在直销柜台开展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	2023 年 03 月 09 日
10	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金通过代销渠道申购（含转换转入、定期定额投资）限制金额的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 09 日
11	《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 10 日

12	《国金基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台申购(含转换转入)旗下基金实施费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 29 日
13	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2022 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 30 日
14	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 31 日
15	《关于调整国金量化多因子股票型证券投资基金单笔申购最低金额的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 20 日
16	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
17	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金通过代销渠道申购(含转换转入、定期定额投资)限制金额的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 05 月 25 日
18	《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	2023 年 06 月 16 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

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

12.3 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

2023 年 8 月 30 日