

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资  
基金  
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	65
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.....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>68</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	68
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	72
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>74</b>

---

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>75</b>
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国金量化多策略
场内简称	-
基金主代码	005443
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	47,427,036.46 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。</p> <p>2、量化选股模型</p> <p>(1) 多因子选股策略</p> <p>本基金股票部分的构建主要采用 Alpha 多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的大量因子信息，引入先进的因子筛选技术，动态捕捉市场热点，快速适应新的市场环境，对全市场股票进行筛选，增大组合的超市场收益。本基金在股票投资过程中，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产超越业绩基准的回报。</p> <p>(2) 统计套利策略</p> <p>本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内部个股之间的稳定性关系，将套利建立在对历史数据进行统计分析的基础之上，估计相关变量的概率分布进行套利操作。</p> <p>(3) 事件驱动套利策略</p>

	<p>本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的 时间以及对过往事件的数据检测，获取时间影响所带 来的超额投资回报。</p> <p>(4) 投资组合优化</p> <p>本基金根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整 个股权重，在控制风险的前提下追求收益最大化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，管理人 将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的 回报。</p> <p>(1) 在债券投资方面，管理人将以宏观形势及利率分 析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照 指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实 施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况， 预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评 价。</p> <p>(2) 可转债投资策略</p> <p>本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券 的估值与价格变化的研究，采用买入低转换溢价率的 债券并持有的投资策略，密切关注可转换债券市场与 股票市场之间的互动关系，选择恰当的时机进行套利， 获得超额收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现 金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政 策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对 个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将 严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投 资，以降低流动性风险。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约， 以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场 进行量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的 估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资 操作。</p> <p>6、股票期权合约投资策略。</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目 的，主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进 行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资 效率，从而更好地实现投资目标。</p> <p>基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门 或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事 项，以防范股票期权投资的风险。</p> <p>7、国债期货投资策略</p>
--	---

	<p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现超额回报。</p> <p>8、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p>
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

注：无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽	石立平
	联系电话	010-88005632	010-63639180
	电子邮箱	zhangli@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100089	100033
法定代表人		尹庆军	李晓鹏

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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办公场所
------------	------------------

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	5,641,452.42
本期利润	5,796,041.42
加权平均基金份额本期利润	0.0827
本期加权平均净值利润率	8.30%
本期基金份额净值增长率	9.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	2,416,249.35
期末可供分配基金份额利润	0.0509
期末基金资产净值	51,070,195.32
期末基金份额净值	1.0768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	7.68%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

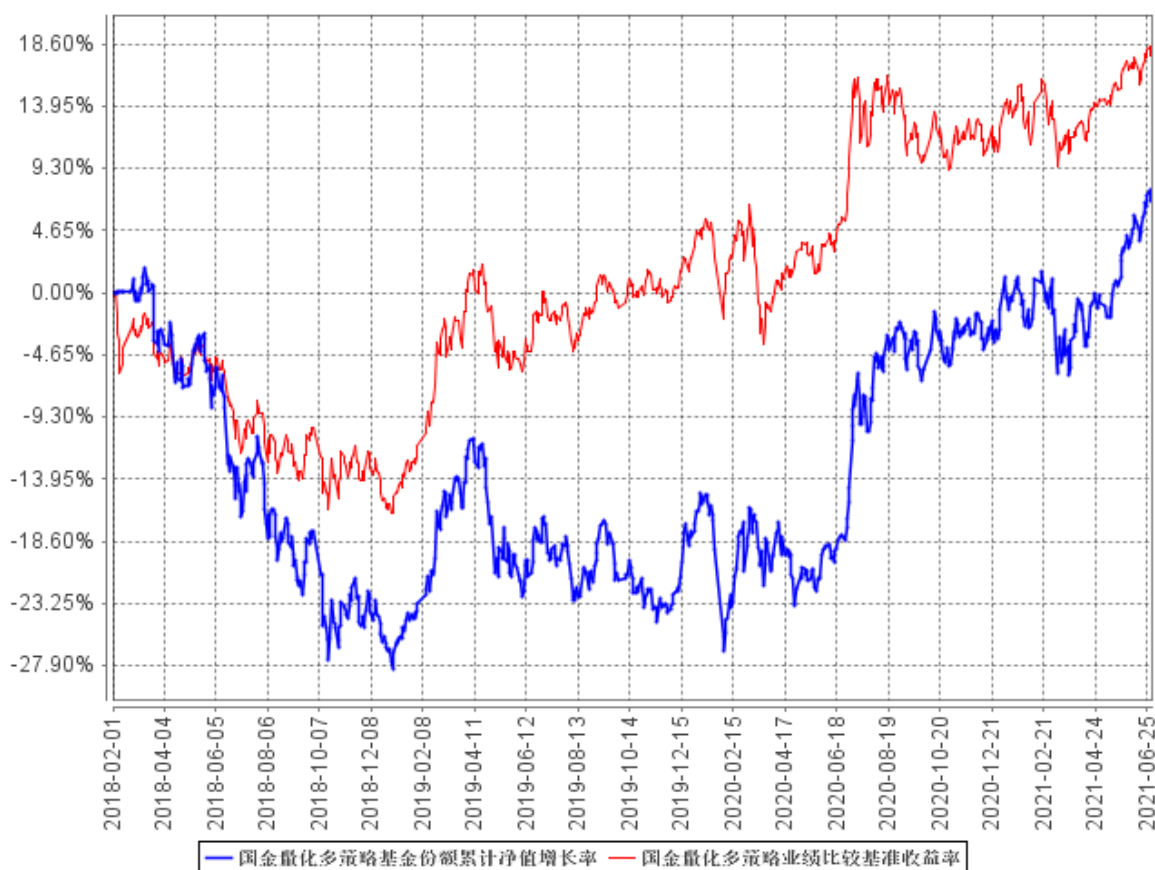
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.63%	0.58%	0.79%	0.44%	2.84%	0.14%
过去三个月	10.92%	0.72%	5.81%	0.41%	5.11%	0.31%
过去六个月	9.14%	0.94%	5.20%	0.60%	3.94%	0.34%
过去一年	30.70%	0.97%	11.31%	0.75%	19.39%	0.22%
过去三年	23.97%	1.13%	30.65%	0.80%	-6.68%	0.33%
自基金合同生效起至今	7.68%	1.12%	18.17%	0.79%	-10.49%	0.33%

注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”。

### 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

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



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2021年6月30日，国金基金管理有限公司共管理25只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	本基金基金经理，国金鑫新灵活配置（LOF）、国金300指数增强、国金上证50指数增强	2020年6月10日	-	13	宫雪女士，中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事

	(LOF)、 国金鑫瑞 灵活、国 金红利增 强、国金 量化多因 子、国金 量化添利 基金经 理，创新 投资部总 经理				业部总经理、量化投资事 业三部总经理兼产品中心 代总经理；现任创新投资 部总经理。
--	---	--	--	--	--

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

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

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金量化多策略灵活配置混合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 9% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0768 元，累计单位净值为 1.0768 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.14%，业绩比较基准收益率为 5.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对宏观经济的总体判断如下：1) 货币政策方面会相对宽松；2) 权益市场估值水平在历史低位区间；3) 企业盈利处于触底阶段。市场判断多样化的趋势一定程度上有利于量化投资运作。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》

议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

本报告期内，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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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,中国光大银行股份有限公司在国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)托管过程中,严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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,中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。



## § 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：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,125,182.34	14,251,804.20
结算备付金		2,904,766.07	3,600,812.24
存出保证金		114,259.61	402,760.06
交易性金融资产	6.4.7.2	40,331,782.08	93,207,024.25
其中：股票投资		40,331,782.08	92,706,974.25
基金投资		-	-
债券投资		-	500,050.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,700,000.00	7,800,000.00
应收证券清算款		836,894.99	935,783.26
应收利息	6.4.7.5	9,505.46	19,774.47
应收股利		-	-
应收申购款		8,906.69	10,759.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		55,031,297.24	120,228,718.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		469,604.33	7,717,511.93
应付赎回款		1,609,237.47	753,596.88
应付管理人报酬		67,239.40	140,351.96
应付托管费		11,206.58	23,392.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,719,493.32	2,679,218.17
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,320.82	170,215.01
负债合计		3,961,101.92	11,484,285.95
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	47,427,036.46	110,221,627.53
未分配利润	6.4.7.10	3,643,158.86	-1,477,195.13
所有者权益合计		51,070,195.32	108,744,432.40
负债和所有者权益总计		55,031,297.24	120,228,718.35

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0768 元，基金份额总额 47,427,036.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		7,388,335.68	1,966,615.34
1.利息收入		133,673.42	138,761.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,677.63	135,489.60
债券利息收入		1,704.66	3,272.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		85,291.13	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,095,797.76	1,491,397.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,779,639.61	814,527.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-10,684.30	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	326,842.45	676,870.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	154,589.00	313,966.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,275.50	22,489.26
<b>减：二、费用</b>		1,592,294.26	4,070,150.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	522,888.93	1,237,552.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	87,148.17	206,258.74

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	897,714.60	2,531,997.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.23
7. 其他费用	6.4.7.20	84,542.56	94,342.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,796,041.42	-2,103,535.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,796,041.42	-2,103,535.60

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	110,221,627.53	-1,477,195.13	108,744,432.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,796,041.42	5,796,041.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-62,794,591.07	-675,687.43	-63,470,278.50
其中：1. 基金申购款	825,748.46	3,488.34	829,236.80
2. 基金赎回款	-63,620,339.53	-679,175.77	-64,299,515.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	47,427,036.46	3,643,158.86	51,070,195.32
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	243,481,336.86	-42,216,557.03	201,264,779.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,103,535.60	-2,103,535.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-71,176,132.12	13,983,622.68	-57,192,509.44
其中：1.基金申购款	3,723,226.09	-772,147.11	2,951,078.98
2.基金赎回款	-74,899,358.21	14,755,769.79	-60,143,588.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	172,305,204.74	-30,336,469.95	141,968,734.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

尹庆军
  聂武鹏
  于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1615号文的核准，由国金基金管理有限公司于2018年1月8日至2018年1月26日向社会公开募集，基金合同于2018年2月1日生效。首次募集规模为425,485,490.92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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 0-95%；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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

##### 6.4.4.1 会计年度

**6.4.4.2 记账本位币**

-

**6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

-

**6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

-

**6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

-

**6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

-

**6.4.4.7 实收基金**

-

**6.4.4.8 损益平准金**

-

**6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

-

**6.4.4.10 费用的确认和计量**

-

**6.4.4.11 基金的收益分配政策**

-

**6.4.4.12 分部报告**

-

**6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

-

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### 1. 印花税

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

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

### 2. 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简

称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

### 3. 企业所得税

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

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

### 4. 个人所得税

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

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



持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,125,182.34
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	5,125,182.34

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,385,285.79	40,331,782.08	946,496.29
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	39,385,285.79	40,331,782.08	946,496.29

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,700,000.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,014.84
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	8,439.22
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	51.40
合计	9,505.46

**6.4.7.6 其他资产**

注：无

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	1,719,493.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,719,493.32

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18.26
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	84,320.82

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,221,627.53	110,221,627.53
本期申购	825,748.46	825,748.46
本期赎回(以“-”号填列)	-63,620,339.53	-63,620,339.53
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	47,427,036.46	47,427,036.46

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,180,082.69	1,702,887.56	-1,477,195.13
本期利润	5,641,452.42	154,589.00	5,796,041.42
本期基金份额交易产生的变动数	-45,120.38	-630,567.05	-675,687.43
其中：基金申购款	-680.16	4,168.50	3,488.34
基金赎回款	-44,440.22	-634,735.55	-679,175.77

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,416,249.35	1,226,909.51	3,643,158.86

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入	20,125.63	
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	24,716.01	
其他	1,835.99	
合计	46,677.63	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额	348,938,669.17	
减：卖出股票成本总额	342,159,029.56	
买卖股票差价收入	6,779,639.61	

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,684.30	
债券投资收益——赎回差价收入	-	
债券投资收益——申购差价收入	-	
合计	-10,684.30	

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	512,200.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	510,684.30
减：应收利息总额	12,200.00
买卖债券差价收入	-10,684.30

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：无

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无

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

注：无

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	326,842.45
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	326,842.45

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	154,589.00
——股票投资	143,954.70
——债券投资	10,634.30
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	154,589.00

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,274.01

转出费收入	1.49
合计	4,275.50

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	897,714.60
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	897,714.60

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	240.00
合计	84,542.56

#### 6.4.7.21 分部报告

无

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司（以下简称“国金证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国金证券	257,473,922.93	40.37%	910,771,280.41	48.32%

###### 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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国金证券	188,290.58	38.26%	481,610.52	28.01%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国金证券	666,048.09	47.93%	666,048.09	39.78%

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	522,888.93
其中：支付销售机构的客户维护费	245,885.27	583,517.28

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人于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基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,148.17	206,258.74

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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，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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

注：无

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行-活期存款	5,125,182.34	20,125.63	45,648,162.06	103,961.60

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

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末进行利润分配。

**6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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	可流通日	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
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	锁定期股票流通受限	12.25	53.71	241	2,952.25	12,944.11	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	锁定期股票流通受限	10.76	22.20	311	3,346.36	6,904.20	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期股票流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300932	三友	2021年	2021	锁定期	24.69	31.71	202	4,987.38	6,405.42	-

	联众	1月15日	年7月22日	股票流通受限						
--	----	-------	--------	--------	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

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

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

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级的债券。

##### **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未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### **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未持有短期信用评级的同业存单。

##### **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未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 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未持有长期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整久期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风

险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,125,182.34	-	-	-	-	-	5,125,182.34
结算备付金	2,904,766.07	-	-	-	-	-	2,904,766.07
存出保证金	114,259.61	-	-	-	-	-	114,259.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	40,331,782.08	40,331,782.08
买入返售金融资产	5,700,000.00	-	-	-	-	-	5,700,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	836,894.99	836,894.99
应收利息	-	-	-	-	-	9,505.46	9,505.46
应收申购款	-	-	-	-	-	8,906.69	8,906.69
资产总计	13,844,208.02	-	-	-	-	41,187,089.22	55,031,297.24
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	469,604.33	469,604.33
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,609,237.47	1,609,237.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,239.40	67,239.40
应付托管费	-	-	-	-	-	11,206.58	11,206.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,719,493.32	1,719,493.32
其他负债	-	-	-	-	-	84,320.82	84,320.82
负债总计	-	-	-	-	-	3,961,101.92	3,961,101.92
利率敏感度缺口	13,844,208.02	-	-	-	-	-37,225,987.30	51,070,195.32
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	14,251,804.20	-	-	-	-	-	14,251,804.20
结算备付金	3,600,812.24	-	-	-	-	-	3,600,812.24
存出保证金	402,760.06	-	-	-	-	-	402,760.06
交易性金融资产	-	500,050.00	-	-	-	92,706,974.25	93,207,024.25
买入返售金融资产	7,800,000.00	-	-	-	-	-	7,800,000.00

应收证券清算款	-	-	-	-	935,783.26	935,783.26
应收利息	-	-	-	-	19,774.47	19,774.47
应收申购款	-	-	-	-	10,759.87	10,759.87
资产总计	26,055,376.50	500,050.00	-	-	-93,673,291.85	120,228,718.35
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	7,717,511.93	7,717,511.93
应付赎回款	-	-	-	-	753,596.88	753,596.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	140,351.96	140,351.96
应付托管费	-	-	-	-	23,392.00	23,392.00
应付交易费用	-	-	-	-	2,679,218.17	2,679,218.17
其他负债	-	-	-	-	170,215.01	170,215.01
负债总计	-	-	-	-	-11,484,285.95	-11,484,285.95
利率敏感度缺口	26,055,376.50	500,050.00	-	-	-82,189,005.90	108,744,432.40

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比



		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	40,331,782.08	78.97	92,706,974.25	85.25
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	500,050.00	0.46
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	40,331,782.08	78.97	93,207,024.25	85.71

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	5%	1,523,607.81	3,837,162.98
	-5%	-1,523,607.81	-3,837,162.98

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

注：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 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	40,331,782.08	73.29
	其中：股票	40,331,782.08	73.29
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	5,700,000.00	10.36
	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	8,029,948.41	14.59
8	其他各项资产	969,566.75	1.76
9	合计	55,031,297.24	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	36,707.00	0.07
B	采矿业	1,970,721.00	3.86
C	制造业	24,615,866.94	48.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	747,647.24	1.46
E	建筑业	796,350.00	1.56
F	批发和零售业	1,300,091.11	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	768,396.60	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,537,715.94	8.89
J	金融业	2,342,159.10	4.59
K	房地产业	540,138.60	1.06
L	租赁和商务服务业	822,991.00	1.61
M	科学研究和技术服务业	1,036,808.55	2.03
N	水利、环境和公共设施管理业	439,451.00	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	228,848.00	0.45
S	综合	147,890.00	0.29
	合计	40,331,782.08	78.97

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	17,700	959,163.00	1.88
2	300601	康泰生物	4,700	700,300.00	1.37
3	300896	爱美客	800	631,104.00	1.24
4	601888	中国中免	2,100	630,210.00	1.23
5	002460	赣锋锂业	5,200	629,668.00	1.23
6	000568	泸州老窖	2,600	613,444.00	1.20
7	300014	亿纬锂能	5,500	571,615.00	1.12
8	603799	华友钴业	4,800	548,160.00	1.07
9	601899	紫金矿业	54,100	524,229.00	1.03
10	603501	韦尔股份	1,600	515,200.00	1.01
11	601601	中国太保	17,700	512,769.00	1.00
12	603288	海天味业	3,380	435,851.00	0.85
13	000063	中兴通讯	13,000	431,990.00	0.85
14	600845	宝信软件	8,320	423,488.00	0.83
15	000858	五粮液	1,400	417,046.00	0.82
16	600745	闻泰科技	4,100	397,290.00	0.78
17	300759	康龙化成	1,700	368,883.00	0.72
18	601088	中国神华	16,800	327,936.00	0.64
19	603486	科沃斯	1,400	319,312.00	0.63
20	600588	用友网络	9,500	315,970.00	0.62
21	300496	中科创达	2,000	314,120.00	0.62
22	603259	药明康德	1,920	300,652.80	0.59
23	600362	江西铜业	13,200	295,416.00	0.58
24	000825	太钢不锈	39,100	292,859.00	0.57
25	600570	恒生电子	3,100	289,075.00	0.57

26	300760	迈瑞医疗	600	288,030.00	0.56
27	601799	星宇股份	1,200	270,864.00	0.53
28	603444	吉比特	500	265,000.00	0.52
29	002643	万润股份	14,800	263,144.00	0.52
30	600028	中国石化	57,500	250,700.00	0.49
31	601225	陕西煤业	21,000	248,850.00	0.49
32	600660	福耀玻璃	4,400	245,740.00	0.48
33	000026	飞亚达	15,900	221,328.00	0.43
34	300597	吉大通信	23,300	215,758.00	0.42
35	300750	宁德时代	400	213,920.00	0.42
36	002410	广联达	3,000	204,600.00	0.40
37	300122	智飞生物	1,000	186,730.00	0.37
38	300763	锦浪科技	1,020	184,212.00	0.36
39	600809	山西汾酒	400	179,200.00	0.35
40	002791	坚朗五金	900	174,645.00	0.34
41	601168	西部矿业	14,400	171,792.00	0.34
42	000860	顺鑫农业	4,000	168,720.00	0.33
43	603195	公牛集团	800	161,600.00	0.32
44	300725	药石科技	1,000	158,910.00	0.31
45	300454	深信服	600	155,688.00	0.30
46	601319	中国人保	25,900	153,587.00	0.30
47	300724	捷佳伟创	1,300	150,813.00	0.30
48	002402	和而泰	6,000	143,820.00	0.28
49	002056	横店东磁	10,800	140,400.00	0.27
50	000898	鞍钢股份	30,200	134,390.00	0.26
51	600309	万华化学	1,200	130,584.00	0.26
52	600328	中盐化工	8,800	122,936.00	0.24
53	600064	南京高科	13,200	122,628.00	0.24
54	000728	国元证券	15,300	121,941.00	0.24
55	603008	喜临门	3,600	118,836.00	0.23
56	605376	博迁新材	1,600	118,208.00	0.23
57	000786	北新建材	3,000	117,750.00	0.23
58	601717	郑煤机	9,400	109,322.00	0.21
59	300685	艾德生物	1,000	104,080.00	0.20
60	300101	振芯科技	5,800	103,878.00	0.20
61	601198	东兴证券	9,500	103,835.00	0.20
62	600997	开滦股份	13,400	100,500.00	0.20
63	002683	宏大爆破	3,600	99,972.00	0.20
64	300726	宏达电子	1,400	98,686.00	0.19

65	300212	易华录	3,600	96,876.00	0.19
66	603126	中材节能	10,500	95,760.00	0.19
67	000923	河钢资源	5,000	95,350.00	0.19
68	603489	八方股份	400	94,552.00	0.19
69	002244	滨江集团	22,400	93,856.00	0.18
70	601077	渝农商行	23,500	93,765.00	0.18
71	603533	掌阅科技	3,200	91,200.00	0.18
72	002106	莱宝高科	8,100	91,125.00	0.18
73	300535	达威股份	6,700	90,852.00	0.18
74	600487	亨通光电	7,900	90,060.00	0.18
75	000959	首钢股份	15,900	89,358.00	0.17
76	600717	天津港	22,560	88,435.20	0.17
77	300017	网宿科技	15,000	87,750.00	0.17
78	600970	中材国际	9,500	87,115.00	0.17
79	603039	泛微网络	1,300	86,515.00	0.17
80	600623	华谊集团	9,600	84,576.00	0.17
81	300866	安克创新	500	83,735.00	0.16
82	002608	江苏国信	12,800	81,664.00	0.16
83	603228	景旺电子	3,100	81,220.00	0.16
84	300151	昌红科技	3,000	80,820.00	0.16
85	600330	天通股份	8,100	79,461.00	0.16
86	300642	透景生命	900	77,229.00	0.15
87	600378	昊华科技	3,500	77,105.00	0.15
88	000937	冀中能源	19,400	76,242.00	0.15
89	300068	南都电源	7,000	74,200.00	0.15
90	600435	北方导航	9,200	73,048.00	0.14
91	600100	同方股份	11,600	70,876.00	0.14
92	300659	中孚信息	2,100	70,497.00	0.14
93	603078	江化微	2,700	69,741.00	0.14
94	600116	三峡水利	8,300	69,388.00	0.14
95	300520	科大国创	3,200	68,960.00	0.14
96	000810	创维数字	8,100	68,931.00	0.13
97	002538	司尔特	10,000	68,500.00	0.13
98	603520	司太立	1,100	67,815.00	0.13
99	000821	京山轻机	7,500	67,500.00	0.13
100	002839	张家港行	12,400	67,456.00	0.13
101	601968	宝钢包装	7,000	66,920.00	0.13
102	002978	安宁股份	1,100	66,462.00	0.13
103	600562	国睿科技	4,400	66,308.00	0.13

104	000685	中山公用	8,100	66,096.00	0.13
105	002936	郑州银行	18,000	66,060.00	0.13
106	603068	博通集成	800	65,840.00	0.13
107	002859	洁美科技	2,100	65,667.00	0.13
108	002609	捷顺科技	6,500	65,065.00	0.13
109	600131	国网信通	4,800	63,552.00	0.12
110	603323	苏农银行	14,500	63,510.00	0.12
111	002182	云海金属	5,300	63,494.00	0.12
112	603416	信捷电气	1,000	63,470.00	0.12
113	600017	日照港	23,700	63,279.00	0.12
114	603983	丸美股份	1,200	62,532.00	0.12
115	002913	奥士康	800	62,360.00	0.12
116	601801	皖新传媒	13,200	62,304.00	0.12
117	603936	博敏电子	5,200	61,620.00	0.12
118	603050	科林电气	4,600	61,594.00	0.12
119	300302	同有科技	5,700	61,503.00	0.12
120	300127	银河磁体	3,500	61,285.00	0.12
121	000901	航天科技	7,100	61,273.00	0.12
122	600363	联创光电	2,200	61,270.00	0.12
123	600633	浙数文化	8,500	61,030.00	0.12
124	600125	铁龙物流	12,300	60,639.00	0.12
125	300126	锐奇股份	8,200	60,598.00	0.12
126	300177	中海达	6,100	60,146.00	0.12
127	300563	神宇股份	3,700	60,088.00	0.12
128	600770	综艺股份	9,600	59,808.00	0.12
129	300776	帝尔激光	400	59,744.00	0.12
130	002327	富安娜	7,700	59,598.00	0.12
131	600269	赣粤高速	17,700	59,472.00	0.12
132	600682	南京新百	5,900	59,354.00	0.12
133	600343	航天动力	6,000	59,340.00	0.12
134	600210	紫江企业	12,400	58,900.00	0.12
135	600959	江苏有线	19,300	58,865.00	0.12
136	600184	光电股份	5,400	58,698.00	0.11
137	600312	平高电气	10,000	58,400.00	0.11
138	002267	陕天然气	8,500	58,395.00	0.11
139	300318	博晖创新	7,200	58,104.00	0.11
140	600502	安徽建工	14,900	57,812.00	0.11
141	600859	王府井	2,000	57,760.00	0.11
142	605369	拱东医疗	500	57,510.00	0.11

143	600640	号百控股	4,700	57,293.00	0.11
144	000851	高鸿股份	8,600	57,190.00	0.11
145	300099	精准信息	7,200	57,168.00	0.11
146	603383	顶点软件	2,000	56,860.00	0.11
147	600283	钱江水利	4,900	56,840.00	0.11
148	002813	路畅科技	2,200	56,738.00	0.11
149	000936	华西股份	8,100	56,700.00	0.11
150	002125	湘潭电化	7,100	56,587.00	0.11
151	002109	兴化股份	11,800	56,522.00	0.11
152	002298	中电兴发	7,900	56,406.00	0.11
153	600446	金证股份	3,900	56,316.00	0.11
154	002442	龙星化工	8,800	54,912.00	0.11
155	603666	亿嘉和	600	54,696.00	0.11
156	000700	模塑科技	9,800	54,390.00	0.11
157	002060	粤水电	15,500	54,095.00	0.11
158	300047	天源迪科	7,400	54,020.00	0.11
159	300841	康华生物	200	53,760.00	0.11
160	601010	文峰股份	16,600	53,452.00	0.10
161	600538	国发股份	7,900	53,246.00	0.10
162	600742	一汽富维	5,200	52,988.00	0.10
163	300276	三丰智能	13,300	52,801.00	0.10
164	000823	超声电子	4,700	52,781.00	0.10
165	300684	中石科技	2,400	52,680.00	0.10
166	300922	天秦装备	1,507	52,488.81	0.10
167	600458	时代新材	6,300	52,479.00	0.10
168	300401	花园生物	4,000	52,200.00	0.10
169	603601	再升科技	4,500	52,065.00	0.10
170	002228	合兴包装	13,800	51,750.00	0.10
171	300816	艾可蓝	600	51,228.00	0.10
172	300428	立中集团	3,900	51,129.00	0.10
173	600395	盘江股份	7,200	51,120.00	0.10
174	300022	吉峰科技	10,800	51,084.00	0.10
175	300170	汉得信息	6,800	50,796.00	0.10
176	002475	立讯精密	1,100	50,600.00	0.10
177	000025	特力 A	3,400	50,592.00	0.10
178	600433	冠豪高新	9,400	50,478.00	0.10
179	300031	宝通科技	3,200	50,432.00	0.10
180	300768	迪普科技	1,300	50,219.00	0.10
181	600602	云赛智联	8,400	49,812.00	0.10

182	000887	中鼎股份	4,100	49,528.00	0.10
183	002362	汉王科技	2,400	49,440.00	0.10
184	300388	节能国祯	6,500	49,400.00	0.10
185	603197	保隆科技	1,500	49,335.00	0.10
186	002912	中新赛克	1,200	49,164.00	0.10
187	603118	共进股份	5,300	48,919.00	0.10
188	601326	秦港股份	18,200	48,776.00	0.10
189	603776	永安行	2,700	48,735.00	0.10
190	002929	润建股份	1,900	48,678.00	0.10
191	600611	大众交通	13,900	48,650.00	0.10
192	603367	辰欣药业	3,900	48,360.00	0.09
193	002630	华西能源	21,800	47,960.00	0.09
194	002334	英威腾	8,300	47,642.00	0.09
195	603421	鼎信通讯	6,300	47,628.00	0.09
196	300245	天玑科技	5,300	47,541.00	0.09
197	002047	宝鹰股份	13,500	47,385.00	0.09
197	300195	长荣股份	8,100	47,385.00	0.09
198	000554	泰山石油	10,200	47,226.00	0.09
199	600483	福能股份	4,500	47,205.00	0.09
200	300241	瑞丰光电	6,400	47,168.00	0.09
201	002635	安洁科技	3,200	46,816.00	0.09
202	600757	长江传媒	8,800	46,728.00	0.09
203	601595	上海电影	4,000	46,640.00	0.09
204	300683	海特生物	1,100	46,376.00	0.09
205	002560	通达股份	7,500	46,275.00	0.09
206	000809	铁岭新城	23,600	46,256.00	0.09
207	000850	华茂股份	12,600	46,116.00	0.09
208	300197	节能铁汉	14,900	45,743.00	0.09
209	300858	科拓生物	600	45,702.00	0.09
210	000599	青岛双星	10,900	45,453.00	0.09
211	000553	安道麦 A	4,900	45,423.00	0.09
212	603786	科博达	600	45,300.00	0.09
213	605006	山东玻纤	3,700	45,140.00	0.09
214	002297	博云新材	5,900	44,781.00	0.09
215	600367	红星发展	5,000	44,750.00	0.09
216	603133	碳元科技	4,300	44,462.00	0.09
217	601606	长城军工	4,300	44,419.00	0.09
218	603110	东方材料	1,400	44,408.00	0.09
219	603590	康辰药业	1,200	44,268.00	0.09



220	600805	悦达投资	11,800	44,132.00	0.09
221	600491	龙元建设	8,200	44,116.00	0.09
222	002189	中光学	2,700	43,875.00	0.09
223	603186	华正新材	1,200	43,752.00	0.09
224	300586	美联新材	4,900	43,365.00	0.08
225	002669	康达新材	3,400	43,282.00	0.08
226	603508	思维列控	2,200	43,142.00	0.08
227	603618	杭电股份	6,800	43,112.00	0.08
228	002393	力生制药	2,300	42,964.00	0.08
229	000777	中核科技	3,600	42,912.00	0.08
230	300578	会畅通讯	1,500	42,645.00	0.08
231	600980	北矿科技	2,800	42,560.00	0.08
232	000404	长虹华意	10,900	42,292.00	0.08
233	600331	宏达股份	20,700	42,228.00	0.08
234	300435	中泰股份	3,500	42,175.00	0.08
235	002807	江阴银行	10,700	42,158.00	0.08
236	300694	蠡湖股份	3,600	42,156.00	0.08
237	300644	南京聚隆	1,200	42,108.00	0.08
238	002412	汉森制药	6,900	41,814.00	0.08
239	300452	山河药辅	2,800	41,776.00	0.08
240	000900	现代投资	10,200	41,718.00	0.08
241	002462	嘉事堂	3,100	41,633.00	0.08
241	002907	华森制药	3,100	41,633.00	0.08
242	002322	理工环科	3,700	41,625.00	0.08
243	603958	哈森股份	4,200	41,538.00	0.08
244	002948	青岛银行	8,300	41,251.00	0.08
245	600135	乐凯胶片	6,300	41,202.00	0.08
246	300165	天瑞仪器	8,500	41,140.00	0.08
247	300879	大叶股份	1,700	41,106.00	0.08
248	002521	齐峰新材	6,300	40,950.00	0.08
249	601588	北辰实业	17,400	40,716.00	0.08
250	603926	铁流股份	2,600	40,664.00	0.08
251	600835	上海机电	2,500	40,625.00	0.08
252	300721	怡达股份	1,100	40,469.00	0.08
253	300050	世纪鼎利	7,500	40,350.00	0.08
254	300304	云意电气	7,700	40,348.00	0.08
255	002546	新联电子	10,800	40,284.00	0.08
256	603889	新澳股份	7,300	40,223.00	0.08
257	002376	新北洋	4,400	40,216.00	0.08

258	300575	中旗股份	1,650	40,194.00	0.08
259	601137	博威合金	3,500	40,145.00	0.08
260	300188	美亚柏科	2,300	40,020.00	0.08
261	002215	诺普信	7,100	39,902.00	0.08
262	603859	能科股份	1,100	39,897.00	0.08
263	000666	经纬纺机	5,000	39,850.00	0.08
264	600939	重庆建工	11,600	39,788.00	0.08
265	300503	昊志机电	3,200	39,712.00	0.08
266	600764	中国海防	1,400	39,620.00	0.08
267	300691	联合光电	2,500	39,575.00	0.08
268	000957	中通客车	6,500	39,520.00	0.08
269	000151	中成股份	5,300	39,379.00	0.08
270	000573	粤宏远 A	12,700	39,370.00	0.08
271	300365	恒华科技	4,800	39,360.00	0.08
272	603220	中贝通信	3,200	39,296.00	0.08
273	300249	依米康	5,600	39,256.00	0.08
274	000888	峨眉山 A	6,100	39,101.00	0.08
275	300871	回盛生物	1,000	39,000.00	0.08
276	300732	设研院	3,600	38,952.00	0.08
277	600642	申能股份	6,300	38,682.00	0.08
278	002958	青农商行	9,000	38,520.00	0.08
279	002551	尚荣医疗	7,100	38,411.00	0.08
280	002873	新天药业	2,000	38,380.00	0.08
281	002955	鸿合科技	2,000	38,180.00	0.07
282	605099	共创草坪	900	38,142.00	0.07
283	002328	新朋股份	8,000	37,920.00	0.07
284	600113	浙江东日	6,200	37,820.00	0.07
285	300380	安硕信息	2,000	37,740.00	0.07
286	300824	北鼎股份	1,500	37,680.00	0.07
287	605399	晨光新材	1,600	37,616.00	0.07
288	002628	成都路桥	11,000	37,510.00	0.07
289	603585	苏利股份	2,500	37,500.00	0.07
290	300650	太龙照明	1,600	37,488.00	0.07
291	000561	烽火电子	5,600	37,464.00	0.07
292	300822	贝仕达克	1,400	37,240.00	0.07
293	603166	福达股份	5,500	37,180.00	0.07
294	000973	佛塑科技	8,600	37,152.00	0.07
295	603709	中源家居	2,100	37,065.00	0.07
296	600501	航天晨光	4,100	37,023.00	0.07

297	600396	金山股份	14,900	36,952.00	0.07
298	002550	千红制药	9,000	36,900.00	0.07
298	002757	南兴股份	2,500	36,900.00	0.07
299	002696	百洋股份	7,100	36,707.00	0.07
300	600736	苏州高新	7,800	36,660.00	0.07
301	002380	科远智慧	2,800	36,624.00	0.07
302	601366	利群股份	5,800	36,308.00	0.07
303	300392	腾信股份	4,500	35,910.00	0.07
304	601668	中国建筑	7,700	35,805.00	0.07
305	000836	富通信息	15,300	35,802.00	0.07
306	002829	星网宇达	1,100	35,596.00	0.07
307	603332	苏州龙杰	2,100	35,532.00	0.07
308	300445	康斯特	2,700	35,505.00	0.07
309	605258	协和电子	1,100	35,365.00	0.07
310	300718	长盛轴承	2,200	35,354.00	0.07
311	300753	爱朋医疗	1,560	35,287.20	0.07
312	300455	康拓红外	3,500	35,245.00	0.07
313	300856	科思股份	700	35,217.00	0.07
314	002404	嘉欣丝绸	5,500	35,200.00	0.07
315	600626	申达股份	8,400	35,112.00	0.07
316	603916	苏博特	1,700	35,088.00	0.07
317	002090	金智科技	4,100	35,055.00	0.07
318	002965	祥鑫科技	1,400	34,986.00	0.07
319	605398	新炬网络	800	34,968.00	0.07
320	000601	韶能股份	6,400	34,944.00	0.07
321	603360	百傲化学	2,500	34,850.00	0.07
322	003015	日久光电	2,700	34,830.00	0.07
323	002866	传艺科技	2,500	34,825.00	0.07
324	000678	襄阳轴承	6,800	34,816.00	0.07
325	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.07
326	300509	新美星	5,000	34,650.00	0.07
327	603703	盛洋科技	2,700	34,290.00	0.07
328	300277	海联讯	4,100	34,276.00	0.07
329	002593	日上集团	9,200	34,224.00	0.07
330	002224	三力士	7,200	33,984.00	0.07
331	000905	厦门港务	5,100	33,966.00	0.07
332	603700	宁水集团	1,400	33,866.00	0.07
333	002753	永东股份	3,700	33,818.00	0.07
334	300295	三六五网	2,900	33,727.00	0.07

335	002815	崇达技术	2,700	33,696.00	0.07
336	300920	润阳科技	1,000	33,680.00	0.07
337	002983	芯瑞达	1,100	33,594.00	0.07
338	300067	安诺其	7,900	33,575.00	0.07
339	603809	豪能股份	2,520	33,314.40	0.07
340	600613	神奇制药	6,200	33,232.00	0.07
341	002277	友阿股份	9,600	33,216.00	0.07
342	002278	神开股份	5,600	33,152.00	0.06
343	002775	文科园林	7,600	33,136.00	0.06
344	600386	北巴传媒	9,400	33,088.00	0.06
345	603378	亚士创能	600	33,012.00	0.06
346	002307	北新路桥	7,300	32,996.00	0.06
347	600235	民丰特纸	6,300	32,949.00	0.06
348	603011	合锻智能	6,800	32,776.00	0.06
349	002033	丽江股份	5,200	32,760.00	0.06
350	600791	京能置业	9,500	32,680.00	0.06
351	600169	太原重工	13,200	32,472.00	0.06
352	300155	安居宝	4,900	32,438.00	0.06
353	002796	世嘉科技	3,000	32,430.00	0.06
353	300886	华业香料	1,000	32,430.00	0.06
354	601616	广电电气	9,900	32,373.00	0.06
355	605338	巴比食品	1,000	32,330.00	0.06
356	002231	奥维通信	6,000	32,160.00	0.06
357	603499	翔港科技	4,200	32,046.00	0.06
358	603328	依顿电子	4,300	32,035.00	0.06
359	002401	中远海科	2,700	31,941.00	0.06
360	000695	滨海能源	5,400	31,914.00	0.06
361	600793	宜宾纸业	2,600	31,902.00	0.06
362	000637	茂化实华	8,200	31,898.00	0.06
363	000557	西部创业	9,000	31,860.00	0.06
364	600990	四创电子	800	31,816.00	0.06
365	603177	德创环保	2,200	31,724.00	0.06
366	002552	宝鼎科技	2,700	31,482.00	0.06
367	300778	新城市	1,625	31,183.75	0.06
368	002634	棒杰股份	5,100	31,161.00	0.06
369	603655	朗博科技	1,500	30,975.00	0.06
370	002494	华斯股份	8,500	30,940.00	0.06
371	002689	远大智能	10,200	30,906.00	0.06
372	300462	华铭智能	2,500	30,825.00	0.06

373	300536	农尚环境	2,300	30,751.00	0.06
374	002209	达意隆	4,500	30,735.00	0.06
375	300855	图南股份	800	30,704.00	0.06
376	603309	维力医疗	2,200	30,690.00	0.06
377	002933	新兴装备	1,200	30,684.00	0.06
378	600706	曲江文旅	4,300	30,401.00	0.06
379	002246	北化股份	4,200	30,240.00	0.06
380	300625	三雄极光	1,900	30,153.00	0.06
381	603869	新智认知	3,400	30,124.00	0.06
382	002863	今飞凯达	6,000	30,120.00	0.06
383	000880	潍柴重机	3,960	30,096.00	0.06
384	600933	爱柯迪	2,300	29,992.00	0.06
385	603269	海鸥股份	2,800	29,848.00	0.06
386	002441	众业达	3,800	29,792.00	0.06
387	002817	黄山胶囊	2,755	29,781.55	0.06
388	603551	奥普家居	2,500	29,700.00	0.06
389	002394	联发股份	3,600	29,412.00	0.06
390	300688	创业黑马	1,500	29,400.00	0.06
391	603789	星光农机	2,300	29,187.00	0.06
392	603090	宏盛股份	2,100	29,106.00	0.06
393	603679	华体科技	1,700	29,036.00	0.06
394	002800	天顺股份	2,240	29,030.40	0.06
395	603009	北特科技	5,000	29,000.00	0.06
396	300084	海默科技	6,400	28,928.00	0.06
397	603030	全筑股份	6,500	28,795.00	0.06
398	002860	星帅尔	1,800	28,710.00	0.06
399	000014	沙河股份	3,700	28,675.00	0.06
400	300757	罗博特科	800	28,640.00	0.06
401	603667	五洲新春	3,000	28,560.00	0.06
402	300809	华辰装备	1,400	28,392.00	0.06
403	300100	双林股份	2,700	28,350.00	0.06
404	300210	森远股份	7,300	28,324.00	0.06
405	002040	南京港	4,700	28,294.00	0.06
406	002898	赛隆药业	2,900	28,275.00	0.06
407	300808	久量股份	2,000	28,240.00	0.06
408	002347	泰尔股份	6,600	28,182.00	0.06
408	002845	同兴达	1,100	28,182.00	0.06
409	605050	福然德	2,600	28,106.00	0.06
410	002363	隆基机械	5,800	28,072.00	0.05

411	605366	宏柏新材	2,300	28,060.00	0.05
412	300918	南山智尚	2,694	28,044.54	0.05
413	002431	棕榈股份	9,600	27,936.00	0.05
414	300399	天利科技	2,200	27,874.00	0.05
415	603106	恒银科技	4,810	27,705.60	0.05
416	300111	向日葵	9,500	27,645.00	0.05
417	600072	中船科技	2,400	27,600.00	0.05
418	000605	渤海股份	5,200	27,560.00	0.05
419	300717	华信新材	1,800	27,468.00	0.05
420	603117	万林物流	7,500	27,375.00	0.05
421	002693	双成药业	6,400	27,328.00	0.05
422	300635	中达安	1,400	27,286.00	0.05
423	300836	佰奥智能	700	27,202.00	0.05
424	002217	合力泰	7,600	27,132.00	0.05
425	002654	万润科技	7,100	27,051.00	0.05
426	002031	巨轮智能	15,100	27,029.00	0.05
427	002806	华锋股份	2,700	26,892.00	0.05
428	002161	远望谷	4,900	26,852.00	0.05
429	600455	博通股份	1,500	26,850.00	0.05
430	002915	中欣氟材	1,400	26,824.00	0.05
431	603706	东方环宇	2,000	26,800.00	0.05
432	605266	健之佳	300	26,700.00	0.05
433	300640	德艺文创	3,900	26,559.00	0.05
434	603256	宏和科技	2,900	26,506.00	0.05
435	002882	金龙羽	3,000	26,490.00	0.05
436	002992	宝明科技	1,600	26,480.00	0.05
437	605318	法狮龙	1,800	26,406.00	0.05
438	300789	唐源电气	1,080	26,395.20	0.05
439	605155	西大门	1,200	26,388.00	0.05
440	600356	恒丰纸业	3,500	26,145.00	0.05
441	300626	华瑞股份	2,900	26,013.00	0.05
442	600790	轻纺城	8,500	25,925.00	0.05
443	003002	壶化股份	2,100	25,914.00	0.05
444	300515	三德科技	2,600	25,870.00	0.05
445	601199	江南水务	7,100	25,773.00	0.05
446	002448	中原内配	4,200	25,620.00	0.05
446	603956	威派格	1,400	25,620.00	0.05
447	300267	尔康制药	6,700	25,594.00	0.05
448	603949	雪龙集团	1,800	25,524.00	0.05

449	600829	人民同泰	4,300	25,499.00	0.05
450	002988	豪美新材	1,900	25,479.00	0.05
451	002559	亚威股份	3,800	25,346.00	0.05
452	002942	新农股份	1,100	25,333.00	0.05
453	300514	友讯达	2,200	25,168.00	0.05
454	002857	三晖电气	1,800	25,146.00	0.05
455	002952	亚世光电	1,800	25,020.00	0.05
456	603115	海星股份	1,800	25,002.00	0.05
457	300303	聚飞光电	4,900	24,941.00	0.05
458	300791	仙乐健康	450	24,930.00	0.05
459	002917	金奥博	2,800	24,696.00	0.05
460	002144	宏达高科	2,700	24,678.00	0.05
461	600107	美尔雅	3,600	24,660.00	0.05
462	600051	宁波联合	3,700	24,642.00	0.05
463	603167	渤海轮渡	2,900	24,563.00	0.05
464	002787	华源控股	4,300	24,467.00	0.05
465	002943	宇晶股份	1,500	24,450.00	0.05
466	601086	国芳集团	6,300	24,444.00	0.05
467	300867	圣元环保	800	24,248.00	0.05
468	605336	帅丰电器	900	24,210.00	0.05
469	002134	天津普林	2,900	24,186.00	0.05
470	002927	泰永长征	2,300	24,173.00	0.05
471	300865	大宏立	800	24,064.00	0.05
472	002877	智能自控	3,600	24,048.00	0.05
473	002823	凯中精密	2,200	23,936.00	0.05
474	002295	精艺股份	3,500	23,905.00	0.05
475	002037	保利联合	4,000	23,880.00	0.05
475	600668	尖峰集团	2,000	23,880.00	0.05
476	002657	中科金财	2,100	23,856.00	0.05
477	002305	南国置业	12,100	23,837.00	0.05
478	300150	世纪瑞尔	5,700	23,826.00	0.05
479	002708	光洋股份	3,900	23,634.00	0.05
480	300851	交大思诺	700	23,597.00	0.05
481	603815	交建股份	2,700	23,490.00	0.05
482	003017	大洋生物	600	23,280.00	0.05
483	605166	聚合顺	2,500	23,250.00	0.05
484	002733	雄韬股份	1,400	23,184.00	0.05
485	601368	绿城水务	4,600	23,138.00	0.05
486	600973	宝胜股份	5,600	23,072.00	0.05

487	300919	中伟股份	141	22,983.00	0.05
488	600463	空港股份	3,800	22,914.00	0.04
489	300148	天舟文化	6,800	22,848.00	0.04
490	603429	集友股份	700	22,750.00	0.04
491	600560	金白天正	2,500	22,650.00	0.04
492	001207	联科科技	682	22,581.02	0.04
493	601226	华电重工	5,600	22,512.00	0.04
494	002014	永新股份	2,600	22,490.00	0.04
495	600969	郴电国际	3,400	22,474.00	0.04
496	600719	大连热电	6,300	22,365.00	0.04
497	300928	华安鑫创	500	22,315.00	0.04
498	603079	圣达生物	1,300	22,191.00	0.04
499	600067	冠城大通	6,600	22,176.00	0.04
500	603103	横店影视	1,500	22,080.00	0.04
501	002795	永和智控	2,000	22,040.00	0.04
502	300780	德恩精工	1,500	21,930.00	0.04
503	002467	二六三	5,000	21,900.00	0.04
504	603331	百达精工	2,200	21,604.00	0.04
505	603559	中通国脉	1,700	21,556.00	0.04
506	600894	广日股份	3,200	21,504.00	0.04
507	000417	合肥百货	4,700	21,338.00	0.04
508	600855	航天长峰	1,600	21,312.00	0.04
509	300605	恒锋信息	1,700	21,250.00	0.04
510	002357	富临运业	4,200	21,126.00	0.04
511	603311	金海高科	1,800	21,060.00	0.04
512	000952	广济药业	2,700	21,033.00	0.04
513	603180	金牌厨柜	440	20,983.60	0.04
514	603767	中马传动	3,100	20,708.00	0.04
515	600033	福建高速	7,800	20,514.00	0.04
516	000061	农产品	3,700	20,424.00	0.04
517	601900	南方传媒	2,600	20,280.00	0.04
517	605128	上海沿浦	600	20,280.00	0.04
518	603668	天马科技	2,800	20,188.00	0.04
519	603067	振华股份	2,700	20,034.00	0.04
520	002820	桂发祥	1,900	19,988.00	0.04
521	002057	中钢天源	2,900	19,981.00	0.04
522	002542	中化岩土	6,600	19,932.00	0.04
523	002729	好利来	400	19,620.00	0.04
524	300585	奥联电子	1,500	19,380.00	0.04



525	603496	恒为科技	1,300	19,357.00	0.04
526	600665	天地源	6,000	19,320.00	0.04
527	600159	大龙地产	7,700	19,096.00	0.04
528	600106	重庆路桥	7,600	19,076.00	0.04
529	003008	开普检测	600	19,056.00	0.04
530	603828	柯利达	4,600	18,998.00	0.04
531	603788	宁波高发	1,500	18,960.00	0.04
532	603937	丽岛新材	1,500	18,945.00	0.04
533	601827	三峰环境	2,000	18,940.00	0.04
534	002391	长青股份	2,700	18,927.00	0.04
535	300227	光韵达	1,900	18,810.00	0.04
536	600101	明星电力	3,500	18,760.00	0.04
537	603843	正平股份	4,600	18,722.00	0.04
538	603800	道森股份	2,000	18,700.00	0.04
539	603507	振江股份	900	18,621.00	0.04
540	600838	上海九百	3,000	18,600.00	0.04
540	603797	联泰环保	2,500	18,600.00	0.04
541	300557	理工光科	700	18,515.00	0.04
542	603798	康普顿	1,800	18,432.00	0.04
543	300877	金春股份	500	18,385.00	0.04
544	300654	世纪天鸿	2,200	18,304.00	0.04
545	603636	南威软件	1,900	18,297.00	0.04
546	002666	德联集团	3,600	18,180.00	0.04
547	603758	秦安股份	2,400	18,024.00	0.04
547	603970	中农立华	800	18,024.00	0.04
548	002671	龙泉股份	4,700	17,813.00	0.03
549	002454	松芝股份	3,300	17,787.00	0.03
550	000548	湖南投资	4,700	17,766.00	0.03
551	000419	通程控股	4,000	17,760.00	0.03
552	603386	广东骏亚	1,000	17,690.00	0.03
553	300570	太辰光	1,100	17,600.00	0.03
554	600287	江苏舜天	3,300	17,556.00	0.03
555	002105	信隆健康	2,200	17,534.00	0.03
556	002850	科达利	200	17,480.00	0.03
557	603200	上海洗霸	1,000	17,470.00	0.03
558	002361	神剑股份	3,600	17,460.00	0.03
559	600854	春兰股份	5,000	17,450.00	0.03
560	002963	豪尔赛	1,100	17,413.00	0.03
561	600769	祥龙电业	3,200	17,376.00	0.03

562	002731	萃华珠宝	2,800	17,332.00	0.03
563	002150	通润装备	2,900	17,197.00	0.03
564	300440	运达科技	2,200	17,094.00	0.03
565	600768	宁波富邦	2,000	17,060.00	0.03
566	603036	如通股份	2,000	17,020.00	0.03
567	300583	赛托生物	800	17,000.00	0.03
568	002591	恒大高新	3,000	16,860.00	0.03
569	300779	惠城环保	1,000	16,850.00	0.03
570	300092	科新机电	1,900	16,758.00	0.03
571	002848	高斯贝尔	1,800	16,632.00	0.03
572	600552	凯盛科技	2,400	16,608.00	0.03
573	002485	希努尔	3,800	16,606.00	0.03
574	000753	漳州发展	6,200	16,554.00	0.03
575	603238	诺邦股份	700	16,520.00	0.03
576	600370	三房巷	5,500	16,500.00	0.03
577	002350	北京科锐	3,100	16,430.00	0.03
578	300402	宝色股份	1,100	16,390.00	0.03
579	002837	英维克	900	16,281.00	0.03
580	603829	洛凯股份	1,500	16,200.00	0.03
581	000968	蓝焰控股	2,500	16,050.00	0.03
582	002495	佳隆股份	6,900	16,008.00	0.03
583	300095	华伍股份	1,600	16,000.00	0.03
584	603607	京华激光	1,100	15,994.00	0.03
585	002809	红墙股份	1,600	15,760.00	0.03
586	603040	新坐标	780	15,740.40	0.03
587	600493	凤竹纺织	3,200	15,680.00	0.03
588	603861	白云电器	1,900	15,675.00	0.03
589	002682	龙洲股份	4,500	15,570.00	0.03
590	002896	中大力德	800	15,496.00	0.03
591	600099	林海股份	2,400	15,480.00	0.03
592	002590	万安科技	2,000	15,380.00	0.03
593	600853	龙建股份	6,300	15,372.00	0.03
594	600163	中闽能源	3,100	15,314.00	0.03
595	603725	天安新材	2,100	15,267.00	0.03
596	002095	生意宝	1,100	15,246.00	0.03
597	605255	天普股份	1,000	15,050.00	0.03
598	603980	吉华集团	2,300	15,042.00	0.03
599	600361	华联综超	4,200	14,994.00	0.03
600	600561	江西长运	3,600	14,976.00	0.03

601	603955	大千生态	1,100	14,905.00	0.03
602	002883	中设股份	1,300	14,898.00	0.03
603	603917	合力科技	1,600	14,752.00	0.03
604	300032	金龙机电	2,900	14,732.00	0.03
605	002899	英派斯	1,100	14,531.00	0.03
606	300065	海兰信	1,300	14,521.00	0.03
607	603029	天鹅股份	1,100	14,410.00	0.03
608	300254	仟源医药	2,000	14,280.00	0.03
609	603662	柯力传感	500	14,250.00	0.03
610	600148	长春一东	1,100	14,223.00	0.03
611	601002	晋亿实业	2,900	14,210.00	0.03
612	300533	冰川网络	700	14,133.00	0.03
613	000715	中兴商业	2,900	13,978.00	0.03
614	601512	中新集团	1,400	13,944.00	0.03
615	600082	海泰发展	4,600	13,938.00	0.03
616	603217	元利科技	500	13,930.00	0.03
617	600168	武汉控股	2,100	13,902.00	0.03
618	600279	重庆港九	3,800	13,870.00	0.03
619	603289	泰瑞机器	1,500	13,845.00	0.03
620	300527	中船应急	1,500	13,785.00	0.03
621	300652	雷迪克	700	13,762.00	0.03
622	000701	厦门信达	2,400	13,704.00	0.03
623	603898	好莱客	1,000	13,700.00	0.03
624	300813	泰林生物	300	13,677.00	0.03
625	000819	岳阳兴长	2,200	13,618.00	0.03
626	603598	引力传媒	1,300	13,611.00	0.03
627	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.03
628	002116	中国海诚	2,200	13,552.00	0.03
629	600833	第一医药	1,500	13,545.00	0.03
630	600326	西藏天路	2,000	13,480.00	0.03
631	300883	龙利得	1,100	13,398.00	0.03
632	600647	同达创业	1,100	13,266.00	0.03
633	603773	沃格光电	500	13,185.00	0.03
634	002868	绿康生化	1,200	13,140.00	0.03
635	600508	上海能源	1,400	13,090.00	0.03
636	002968	新大正	300	13,065.00	0.03
637	600785	新华百货	1,100	12,980.00	0.03
638	300937	药易购	241	12,944.11	0.03
639	600190	锦州港	4,600	12,926.00	0.03

640	603086	先达股份	1,400	12,796.00	0.03
641	000020	深华发 A	1,300	12,753.00	0.02
642	600250	南纺股份	2,700	12,744.00	0.02
643	600551	时代出版	1,700	12,512.00	0.02
644	603320	迪贝电气	1,100	12,452.00	0.02
645	001965	招商公路	1,700	12,274.00	0.02
646	600697	欧亚集团	900	12,231.00	0.02
647	300771	智莱科技	500	12,140.00	0.02
648	603321	梅轮电梯	1,700	12,053.00	0.02
649	002879	长缆科技	800	12,040.00	0.02
650	000985	大庆华科	1,000	11,990.00	0.02
651	603656	泰禾智能	800	11,856.00	0.02
652	603701	德宏股份	1,300	11,739.00	0.02
653	603580	艾艾精工	1,100	11,693.00	0.02
654	603286	日盈电子	800	11,680.00	0.02
655	002478	常宝股份	2,600	11,674.00	0.02
656	603003	龙宇燃油	1,600	11,648.00	0.02
657	300698	万马科技	600	11,592.00	0.02
658	002774	快意电梯	1,800	11,502.00	0.02
659	603602	纵横通信	1,100	11,495.00	0.02
660	603268	松发股份	800	11,472.00	0.02
661	000622	恒立实业	3,300	11,418.00	0.02
662	300539	横河精密	1,500	11,370.00	0.02
663	603390	通达电气	1,200	11,208.00	0.02
664	000766	通化金马	2,200	11,176.00	0.02
665	603569	长久物流	1,500	11,175.00	0.02
666	300599	雄塑科技	1,000	11,090.00	0.02
667	603903	中持股份	1,100	10,923.00	0.02
668	603385	惠达卫浴	1,100	10,813.00	0.02
669	603813	原尚股份	800	10,736.00	0.02
670	603616	韩建河山	2,000	10,720.00	0.02
671	002599	盛通股份	2,800	10,696.00	0.02
672	603922	金鸿顺	700	10,633.00	0.02
673	603006	黎明股份	1,200	10,596.00	0.02
674	603327	福蓉科技	700	10,563.00	0.02
675	000833	粤桂股份	2,300	10,396.00	0.02
676	002296	辉煌科技	1,500	10,380.00	0.02
677	603506	南都物业	720	10,317.60	0.02
678	300695	兆丰股份	200	10,302.00	0.02

679	002112	三变科技	1,400	9,982.00	0.02
680	600843	上工申贝	1,600	9,936.00	0.02
681	000514	渝开发	2,900	9,860.00	0.02
682	603948	建业股份	500	9,510.00	0.02
683	002748	世龙实业	1,500	9,450.00	0.02
684	300289	利德曼	1,500	9,225.00	0.02
685	603823	百合花	600	9,084.00	0.02
686	002674	兴业科技	700	8,995.00	0.02
687	600232	金鹰股份	1,800	8,874.00	0.02
688	300669	沪宁股份	400	8,820.00	0.02
689	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.02
690	000590	启迪药业	1,000	8,720.00	0.02
691	300499	高澜股份	1,000	8,700.00	0.02
692	002830	名雕股份	900	8,685.00	0.02
693	603192	汇得科技	400	8,648.00	0.02
694	600262	北方股份	600	8,634.00	0.02
695	002561	徐家汇	1,200	8,544.00	0.02
696	002953	日丰股份	560	8,416.80	0.02
697	002253	川大智胜	500	8,390.00	0.02
698	002395	双象股份	700	8,316.00	0.02
699	603790	雅运股份	800	8,208.00	0.02
700	300925	法本信息	306	8,044.74	0.02
701	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.02
702	603677	奇精机械	700	7,875.00	0.02
703	601518	吉林高速	3,400	7,752.00	0.02
704	002768	国恩股份	300	7,614.00	0.01
705	002691	冀凯股份	1,800	7,560.00	0.01
706	000023	深天地 A	500	7,495.00	0.01
707	603685	晨丰科技	600	7,326.00	0.01
708	002864	盘龙药业	300	7,296.00	0.01
709	603045	福达合金	600	7,248.00	0.01
710	600617	国新能源	1,800	7,236.00	0.01
711	603908	牧高笛	300	7,104.00	0.01
712	603535	嘉诚国际	200	7,000.00	0.01
713	300545	联得装备	300	6,981.00	0.01
714	300926	博俊科技	311	6,904.20	0.01
715	603095	越剑智能	300	6,876.00	0.01
716	000520	长航凤凰	2,100	6,867.00	0.01
717	603109	神驰机电	300	6,864.00	0.01

718	000815	美利云	1,300	6,812.00	0.01
719	002871	伟隆股份	700	6,776.00	0.01
720	601700	风范股份	1,600	6,720.00	0.01
721	000551	创元科技	800	6,704.00	0.01
722	300564	筑博设计	300	6,678.00	0.01
723	600333	长春燃气	1,400	6,664.00	0.01
724	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
725	603101	汇嘉时代	1,300	6,474.00	0.01
726	300786	国林科技	300	6,465.00	0.01
727	603810	丰山集团	420	6,447.00	0.01
728	300932	三友联众	202	6,405.42	0.01
729	603928	兴业股份	600	6,396.00	0.01
730	601789	宁波建工	1,700	6,256.00	0.01
731	002663	普邦股份	3,500	6,230.00	0.01
731	600537	亿晶光电	1,400	6,230.00	0.01
732	601500	通用股份	1,100	6,072.00	0.01
733	603199	九华旅游	300	6,051.00	0.01
734	603178	圣龙股份	600	6,006.00	0.01
735	002855	捷荣技术	600	5,658.00	0.01
736	002790	瑞尔特	1,000	5,460.00	0.01
737	603530	神马电力	300	5,319.00	0.01
738	300341	麦克奥迪	600	5,256.00	0.01
739	002325	洪涛股份	2,100	5,250.00	0.01
740	300818	耐普矿机	200	5,202.00	0.01
741	603028	赛福天	540	5,076.00	0.01
742	300707	威唐工业	300	5,025.00	0.01
743	603058	永吉股份	700	4,886.00	0.01
744	002779	中坚科技	400	4,252.00	0.01
745	605011	杭州热电	473	4,200.24	0.01
746	002337	赛象科技	1,300	4,004.00	0.01
747	605066	天正电气	300	3,957.00	0.01
748	600778	友好集团	900	3,609.00	0.01
749	601916	浙商银行	900	3,573.00	0.01
750	603578	三星新材	240	3,460.80	0.01
751	000677	恒天海龙	1,200	3,384.00	0.01
752	002771	真视通	300	3,375.00	0.01
753	601068	中铝国际	700	2,415.00	0.00
754	600302	标准股份	500	2,140.00	0.00
755	002742	三圣股份	400	1,896.00	0.00

756	300521	爱司凯	100	1,752.00	0.00
757	603278	大业股份	200	1,656.00	0.00
758	603967	中创物流	100	1,155.00	0.00
759	603817	海峡环保	200	1,120.00	0.00
760	000632	三木集团	300	1,065.00	0.00
761	002909	集泰股份	100	941.00	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	603799	华友钴业	3,043,100.00	2.80
2	601888	中国中免	2,524,162.00	2.32
3	600584	长电科技	2,517,504.00	2.32
4	600893	航发动力	2,510,598.82	2.31
5	000002	万科 A	2,449,234.50	2.25
6	002460	赣锋锂业	2,123,565.00	1.95
7	601328	交通银行	2,106,048.00	1.94
8	603501	韦尔股份	2,067,694.00	1.90
9	000063	中兴通讯	2,034,983.00	1.87
10	600570	恒生电子	2,028,051.00	1.86
11	600760	中航沈飞	2,020,921.00	1.86
12	300677	英科医疗	2,004,155.00	1.84
13	000651	格力电器	1,998,057.00	1.84
14	600048	保利地产	1,970,663.00	1.81
15	600316	洪都航空	1,941,057.00	1.78
16	002415	海康威视	1,916,798.56	1.76
17	600519	贵州茅台	1,824,746.99	1.68
18	600837	海通证券	1,762,243.00	1.62
19	000799	酒鬼酒	1,738,128.00	1.60
20	002475	立讯精密	1,721,647.00	1.58

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	000002	万科 A	3,117,095.00	2.87
2	300677	英科医疗	2,650,275.00	2.44
3	603799	华友钴业	2,617,451.00	2.41
4	002460	赣锋锂业	2,504,873.00	2.30
5	600893	航发动力	2,491,044.00	2.29
6	600584	长电科技	2,453,016.00	2.26
7	002415	海康威视	2,441,488.00	2.25
8	000651	格力电器	2,255,627.00	2.07
9	002714	牧原股份	2,246,120.00	2.07
10	601328	交通银行	2,237,984.00	2.06
11	600436	片仔癀	2,118,661.00	1.95
12	000799	酒鬼酒	2,074,185.00	1.91
13	600760	中航沈飞	2,067,382.00	1.90
14	002475	立讯精密	2,065,655.00	1.90
15	600519	贵州茅台	2,050,813.00	1.89
16	601888	中国中免	2,044,717.00	1.88
17	000063	中兴通讯	2,040,143.00	1.88
18	000661	长春高新	1,961,058.00	1.80
19	000333	美的集团	1,959,031.18	1.80
20	600316	洪都航空	1,894,482.00	1.74

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	289,639,882.69
卖出股票收入（成交）总额	348,938,669.17

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

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

注：无

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：无

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金报告期内未参与国债期货投资。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日被中国银保监会行政处罚，罚款合计 7170 万元。主要违法违规事实：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门

槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本报告期内，本基金投资的前十名股票（如有）未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	114,259.61
2	应收证券清算款	836,894.99
3	应收股利	-
4	应收利息	9,505.46
5	应收申购款	8,906.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	969,566.75

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,692	28,030.16	-	-	47,427,036.46	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	108,247.33	0.2282%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年2月1日）基金份额总额	425,485,490.92
本报告期期初基金份额总额	110,221,627.53
本报告期基金总申购份额	825,748.46
减：本报告期基金总赎回份额	63,620,339.53
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	47,427,036.46

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	257,473,922.93	40.37%	188,290.58	38.26%	-
国融证券	1	134,764,024.13	21.13%	98,553.71	20.02%	-
中信证券	1	128,685,804.93	20.18%	119,845.57	24.35%	-
光大证券	1	116,917,142.98	18.33%	85,501.28	17.37%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国盛证券	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融证券、恒泰证券各一个交易单元。

### 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

国金证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	561,000,000.00	61.24%	-	-
光大证券	-	-	355,100,000.00	38.76%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 1 月 22 日
2	国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 18 日
3	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日
4	国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 2 日
5	国金基金管理有限公司关于旗下	指定披露媒体和本	2021 年 4 月 20 日



	部分证券投资基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	基金基金管理人网站	
6	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
7	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
8	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
9	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要(更新)	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
10	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 21 日
11	国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 12 日
12	国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 19 日

注：本报告期内，基金管理人按照《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、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日