

国金量化添利定期开放债券型发起式证券  
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
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.....	65
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国债期货交易情况说明.....	65
7.11 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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	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.....	71
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>73</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 .....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>74</b>
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国金量化添利
场内简称	-
基金主代码	006189
基金运作方式	契约型定期开放
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	107,589,252.15 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	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金在封闭期和开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>债券类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金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>在债券投资方面，基金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）股票投资策略</p> <p>本基金股票部分以“量化投资”为主要投资策略，“阿尔法多因子选股模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>

业绩比较基准	中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽	吴玉婷
	联系电话	010-88005632	021-52629999-212052
	电子邮箱	zhangli@gfund.com	xywyt@cib.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95561
传真		010-88005666	021-62159217
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	福州市湖东路 154 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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		100089	200120
法定代表人		尹庆军	吕家进

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	3,831,988.59
本期利润	2,837,955.31
加权平均基金份额本期利润	0.0284
本期加权平均净值利润率	2.78%
本期基金份额净值增长率	2.64%
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	4,882,289.87
期末可供分配基金份额利润	0.0454
期末基金资产净值	112,471,542.02
期末基金份额净值	1.0454
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	12.04%

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

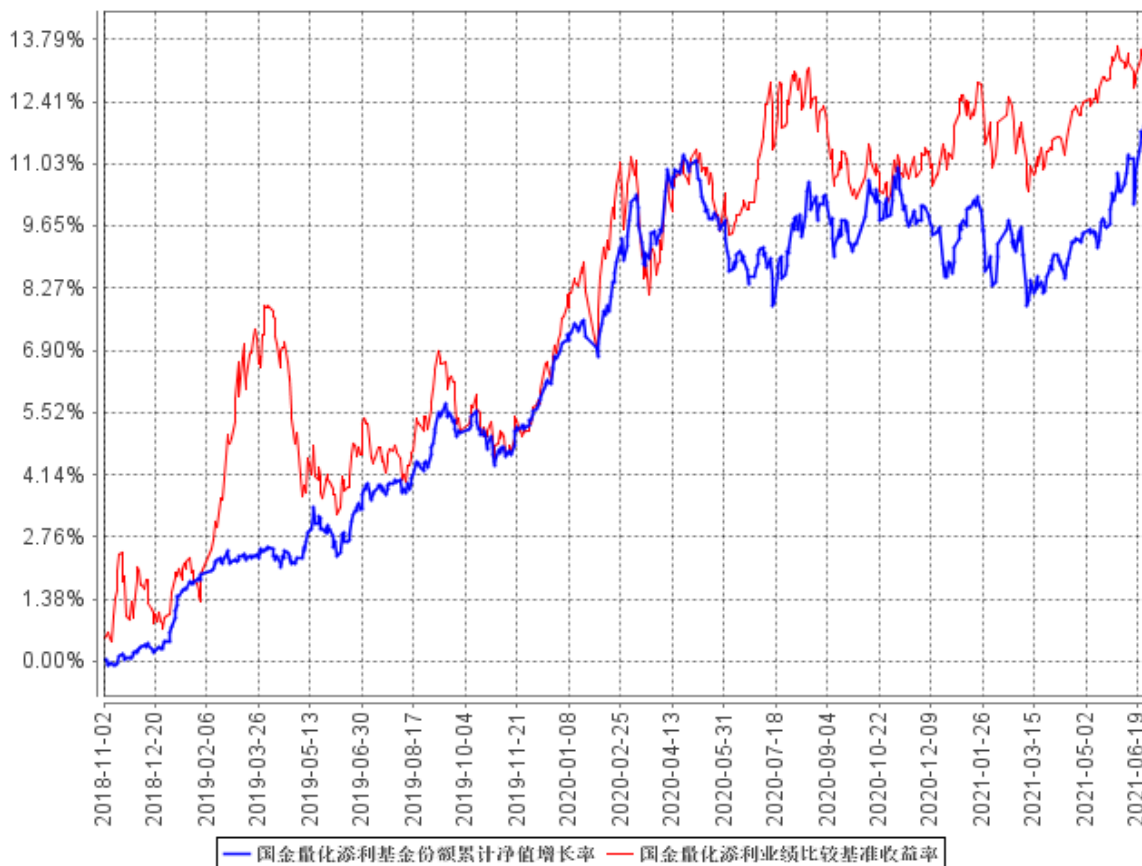
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.37%	0.29%	0.12%	0.16%	1.25%	0.13%
过去三个月	3.08%	0.21%	2.11%	0.15%	0.97%	0.06%
过去六个月	2.64%	0.23%	1.64%	0.21%	1.00%	0.02%
过去一年	3.02%	0.23%	2.73%	0.24%	0.29%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.04%	0.18%	13.71%	0.28%	-1.67%	-0.10%

注：本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数收益率×80%+中证500指数收益率×20%。



### 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

国金量化添利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：本基金合同生效日为 2018 年 11 月 2 日，图示日期为 2018 年 11 月 2 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29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、国金量化多策略基金经理，创新投资部总经理				业部总经理、量化投资事业部三部总经理兼产品中心代总经理；现任创新投资部总经理。
尹海峰	本基金基金经理，国金惠丰 39 个月定开、国金惠享一年定开基金基金经理，研究部副总经理	2019 年 2 月 12 日	-	10	尹海峰先生，中央财经大学硕士。2011 年 7 月至 2016 年 6 月历任中债资信评估有限责任公司信用评级部任研究员，泰康资产管理有限责任公司信用评级部担任信用评估研究总监、信用评估研究高级经理。2016 年 6 月 6 日加入国金基金管理有限公司，历任固定收益部信用研究主管、研究部总经理、研究部固收研究总监；现任研究部副总经理。

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

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

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 11%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

固收方面，债市在 2021 年以来走势持续震荡走强，呈现慢牛走势，中债总财富指数累计上涨 3.54%。除 1 月底-2 月初，4 月份下旬，6 月份收益率有回调外，债市走势均比较强。主要原因是央行在 2 月份开始政策转向稳健中性，6 月底超预期降准，利率债供给高峰不断推迟，通胀读数虽有上行但并未对央行政策取向产生实质性影响。从指数来看，中债总财富指数涨 3.34%，好于信用债总财富指数。以国开债的估值走势为例，10 年期、5 年和 3 年期品种收益率均下行 20bp 左右，收益率曲线呈现出平行下行的慢牛特征。针对债市行情，固收组合积极通过杠杆和久期操作，适度抬升久期和杠杆来博取波段收益和控制收益回撤，增加转债仓位占比把握转债市场结构性机会，尽可能控制固收组合对产品净值波动的影响。

股票方面，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。报告期内依据大类资产配置的投资决议调整股票仓位。

#### 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 1.0454 元，累计单位净值为 1.1174 元，本报告期份额净值增长率为 2.64%，同期业绩比较基准增长率为 1.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在国内经济面临下行压力和未来降准预期的驱动的背景下，下半年债券市场仍有阶段性的行情。虽然四季度通胀读数有回升的风险，但不对国内政策取向形成太大的压力。伴随利空因素和可能的对冲措施逐步落地，收益率整体趋势震荡下行，利率债和高等级信用债仍有机会。信用整体收缩，隐性债务整顿和城投债券融资遭受管控和重整，中低资质信用债需要投资规避，同时需要对美联储货币政策转向、利率债供给高峰、大规模信用违约等风险事件冲击引发的市场调整保持高度关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本报告期内，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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

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	807,534.85	2,707,296.08
结算备付金		2,313,817.82	3,509,749.17
存出保证金		48,875.59	134,520.29
交易性金融资产	6.4.7.2	127,082,759.25	150,822,219.70
其中：股票投资		5,005,596.05	18,148,172.00
基金投资		-	-
债券投资		122,077,163.20	132,674,047.70
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	1,100,000.00	-
应收证券清算款		1,056,865.88	-
应收利息	6.4.7.5	1,251,241.36	2,860,729.53
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		133,661,094.75	160,034,514.77
<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		19,599,790.20	57,354,520.92
应付证券清算款		1,100,001.60	360,745.66
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		42,517.22	53,589.72
应付托管费		8,503.43	10,717.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	336,047.08	226,181.76
应交税费		5,958.92	13,514.21

应付利息		3,431.72	12,921.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,302.56	179,000.00
负债合计		21,189,552.73	58,211,191.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	107,589,252.15	99,977,493.27
未分配利润	6.4.7.10	4,882,289.87	1,845,830.09
所有者权益合计		112,471,542.02	101,823,323.36
负债和所有者权益总计		133,661,094.75	160,034,514.77

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0454 元，基金份额总额 107,589,252.15 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

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>		3,753,101.89	722,613.48
1.利息收入		2,583,425.95	3,974,371.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,680.43	33,448.09
债券利息收入		2,536,369.59	3,939,142.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		22,375.93	1,780.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,163,692.74	4,483,862.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,878,915.15	1,247,412.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	424,634.51	3,074,007.40
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	-222,952.91	-
股利收益	6.4.7.16	83,095.99	162,443.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-994,033.28	-7,737,748.68
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	16.48	2,128.43
<b>减：二、费用</b>		915,146.58	1,648,010.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	253,268.64	437,093.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	50,653.71	87,418.64



3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	233,790.40	291,295.89
5. 利息支出		262,452.06	714,833.92
其中：卖出回购金融资产支出		262,452.06	714,833.92
6. 税金及附加		7,053.37	8,933.84
7. 其他费用	6.4.7.20	107,928.40	108,435.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,837,955.31	-925,397.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,837,955.31	-925,397.51

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

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）	99,977,493.27	1,845,830.09	101,823,323.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,837,955.31	2,837,955.31
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）	7,611,758.88	198,504.47	7,810,263.35
其中：1. 基金申购款	43,575,851.07	1,428,743.85	45,004,594.92
2. 基金赎回款	-35,964,092.19	-1,230,239.38	-37,194,331.57
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）	107,589,252.15	4,882,289.87	112,471,542.02
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)	108,641,890.03	2,898,417.29	111,540,307.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-925,397.51	-925,397.51
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)	270,173,718.03	14,871,209.19	285,044,927.22
其中：1.基金申购款	281,764,709.21	15,502,358.06	297,267,067.27
2.基金赎回款	-11,590,991.18	-631,148.87	-12,222,140.05
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)	378,815,608.06	16,844,228.97	395,659,837.03

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

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1033 号文的核准，由国金基金管理有限公司于 2018 年 10 月 15 日至 2018 年 10 月 26 日向社会公开募集，基金合同于 2018 年 11 月 2 日生效。首次募集规模为 150,011,600.00 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存

款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每次开放期前十五个工作日、开放期及开放期结束后十五个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内本基金不受上述 5%限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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：中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

##### 6.4.4.1 会计年度

**6.4.4.2 记账本位币**

-

**6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

-

**6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

-

**6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

-

**6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

-

**6.4.4.7 实收基金**

-

**6.4.4.8 损益平准金**

-

**6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

-

**6.4.4.10 费用的确认和计量**

-

**6.4.4.11 基金的收益分配政策**

-

**6.4.4.12 分部报告**

-

**6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

-

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	807,534.85
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：	807,534.85

##### 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	4,954,896.88	5,005,596.05	50,699.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	34,898,378.50	33,429,163.20
	银行间市场	90,502,377.50	88,648,000.00
	合计	125,400,756.00	122,077,163.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	130,355,652.88	127,082,759.25	-3,272,893.63

##### 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	1,100,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,100,000.00	-

**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	869.38
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	961.05
应收债券利息	1,249,388.93
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	22.00
合计	1,251,241.36

**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	328,901.33
银行间市场应付交易费用	7,145.75
合计	336,047.08

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,302.56
合计	93,302.56

#### 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	99,977,493.27	99,977,493.27
本期申购	43,575,851.07	43,575,851.07
本期赎回(以“-”号填列)	-35,964,092.19	-35,964,092.19
- 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	107,589,252.15	107,589,252.15

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	2,644,482.03	-798,651.94	1,845,830.09
本期利润	3,831,988.59	-994,033.28	2,837,955.31
本期基金份额交易产生的变动数	422,007.30	-223,502.83	198,504.47
其中：基金申购款	2,403,845.89	-975,102.04	1,428,743.85
基金赎回款	-1,981,838.59	751,599.21	-1,230,239.38

本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,898,477.92	-2,016,188.05	4,882,289.87

#### 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	5,840.89	
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	18,033.31	
其他	806.23	
合计	24,680.43	

#### 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	90,172,206.09	
减：卖出股票成本总额	88,293,290.94	
买卖股票差价收入	1,878,915.15	

#### 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	424,634.51	
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	424,634.51	

**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	255,453,431.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	251,216,593.16
减：应收利息总额	3,812,203.49
买卖债券差价收入	424,634.51

**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**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-222,952.91
股指期货-投资收益	-

**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	83,095.99
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	83,095.99

**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	-994,033.28
——股票投资	-456,267.68
——债券投资	-537,765.60
——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	-994,033.28

**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	16.48
合计	16.48

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	229,240.40
银行间市场交易费用	4,550.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	233,790.40

**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	-
上清所查询服务费	600.00
中债债券账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	8,850.00
银行费用	5,175.84
合计	107,928.40

#### 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，本基金无需要说明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
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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 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	253,268.64	437,093.19
其中：支付销售机构的客户维护费	54,272.01	77,667.51

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，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、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，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	50,653.71	87,418.64

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2018 年 11 月 2 日）持有的基金份额	-	10,000,600.00
报告期初持有的基金份额	10,703,333.61	11,852,028.34
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	1,455,849.89



报告期末持有的基金份额	10,703,333.61	10,396,178.45
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.9483%	2.7444%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国金证券股份有限公司	14,267,097.88	13.2607%	14,267,097.88	14.2703%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 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
兴业银行-活期存款	807,534.85	5,840.89	5,633,091.88	19,514.69

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行行保管，按银行同业利率或约定的利率计息。

#### 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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	350	35,000.00	35,000.00	-

### 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
300660	江苏雷利	2021 年 6 月 21 日	临时停牌	20.57	2021 年 7 月 5 日	20.82	400	7,904.00	8,228.00	-

### 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

截止本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 19,599,790.20 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210207	21 国开 07	2021 年 7 月 1 日	100.00	100,000	10,000,000.00
210205	21 国开 05	2021 年 7 月 1 日	101.25	100,000	10,125,000.00
合计				200,000	20,125,000.00

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	52,767,364.00	74,572,722.00
AAA 以下	19,145,799.20	27,897,325.70
未评级	-	-
合计	71,913,163.20	102,470,047.70

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

##### 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未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	807,534.85	-	-	-	-	-	807,534.85
结算备付金	2,313,817.82	-	-	-	-	-	2,313,817.82
存出保证金	48,875.59	-	-	-	-	-	48,875.59
交易性金融资产	-	-	10,001,000.00	97,167,408.20	14,908,755.00	5,005,596.05	127,082,759.25
买入返售金融资产	1,100,000.00	-	-	-	-	-	1,100,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,056,865.88	1,056,865.88
应收利息	-	-	-	-	-	1,251,241.36	1,251,241.36
资产总计	4,270,228.26	-	10,001,000.00	97,167,408.20	14,908,755.00	7,313,703.29	133,661,094.75
负债							
卖出回购金融资产款	19,599,790.20	-	-	-	-	-	19,599,790.20
应付	-	-	-	-	-	1,100,001.60	1,100,001.60

证券清算款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	42,517.22	42,517.22
应付托管费	-	-	-	-	-	8,503.43	8,503.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	336,047.08	336,047.08
应交税费	-	-	-	-	-	5,958.92	5,958.92
应付利息	-	-	-	-	-	3,431.72	3,431.72
其他负债	-	-	-	-	-	93,302.56	93,302.56
负债总计	19,599,790.20	-	-	-	-	1,589,762.53	21,189,552.73
利率敏感度缺口	-15,329,561.94	-	-10,001,000.00	97,167,408.20	14,908,755.00	5,723,940.76	112,471,542.02
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	2,707,296.08	-	-	-	-	-	2,707,296.08
结算备付金	3,509,749.17	-	-	-	-	-	3,509,749.17
交易性金融资产	18,008,000.00	216,520.00	10,130,027.70	94,183,500.00	10,136,000.00	18,148,172.00	150,822,219.70
应收利息	-	-	-	-	-	2,860,729.53	2,860,729.53
存出	134,520.29	-	-	-	-	-	134,520.29

保证金							
资产总计	24,359,565.54	216,520.00	10,130,027.70	94,183,500.00	10,136,000.00	21,008,901.53	160,034,514.77
负债							
卖出回购金融资产款	57,354,520.92	-	-	-	-	-	57,354,520.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-	360,745.66	360,745.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,589.72	53,589.72
应付托管费	-	-	-	-	-	10,717.93	10,717.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	226,181.76	226,181.76
应付利息	-	-	-	-	-	12,921.21	12,921.21
应交税费	-	-	-	-	-	13,514.21	13,514.21
其他负债	-	-	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	57,354,520.92	-	-	-	-	856,670.49	58,211,191.41
利率敏感度缺口	-32,994,955.38	216,520.00	10,130,027.70	94,183,500.00	10,136,000.00	20,152,231.04	101,823,323.36

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。



分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	+25 个基准点	-903,944.28	-970,310.52
	-25 个基准点	915,577.62	983,482.48

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,005,596.05	4.45	18,148,172.00	17.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	122,077,163.20	108.54	132,674,047.70	130.30
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	127,082,759.25	112.99	150,822,219.70	148.12

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	+5%	1,042,855.86	446,824.64
	-5%	-1,042,855.86	-446,824.64

**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	-	-

**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	5,005,596.05	3.74
	其中：股票	5,005,596.05	3.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	122,077,163.20	91.33
	其中：债券	122,077,163.20	91.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,100,000.00	0.82
	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	3,121,352.67	2.34
8	其他各项资产	2,356,982.83	1.76
9	合计	133,661,094.75	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	31,043.60	0.03
B	采矿业	157,930.00	0.14
C	制造业	3,062,287.45	2.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,735.00	0.07
E	建筑业	140,653.00	0.13
F	批发和零售业	286,665.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	228,217.40	0.20
H	住宿和餐饮业	1,648.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	349,450.00	0.31
J	金融业	210,274.00	0.19
K	房地产业	78,115.60	0.07
L	租赁和商务服务业	73,783.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	195,886.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	59,867.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,330.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	18,346.00	0.02
S	综合	14,365.00	0.01
	合计	5,005,596.05	4.45

### 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	002230	科大讯飞	1,400	94,612.00	0.08
2	603288	海天味业	650	83,817.50	0.07
3	600153	建发股份	10,200	82,620.00	0.07
4	002821	凯莱英	200	74,520.00	0.07
5	300676	华大基因	600	71,160.00	0.06
6	300725	药石科技	400	63,564.00	0.06
7	000728	国元证券	6,800	54,196.00	0.05
8	000063	中兴通讯	1,600	53,168.00	0.05
9	300751	迈为股份	100	45,470.00	0.04
10	600809	山西汾酒	100	44,800.00	0.04
11	600188	兖州煤业	2,900	44,544.00	0.04
12	600498	烽火通信	2,100	39,123.00	0.03
13	002791	坚朗五金	200	38,810.00	0.03
14	603127	昭衍新药	200	36,750.00	0.03
15	600845	宝信软件	700	35,630.00	0.03
16	300529	健帆生物	400	34,544.00	0.03
17	300999	金龙鱼	400	33,984.00	0.03
18	603019	中科曙光	1,200	33,132.00	0.03
19	600309	万华化学	300	32,646.00	0.03
20	000858	五粮液	100	29,789.00	0.03
21	002714	牧原股份	480	29,193.60	0.03
22	002707	众信旅游	4,500	27,765.00	0.02
23	600859	王府井	900	25,992.00	0.02
24	300482	万孚生物	390	25,229.10	0.02
25	600362	江西铜业	1,100	24,618.00	0.02

26	002293	罗莱生活	1,800	24,102.00	0.02
27	600100	同方股份	3,800	23,218.00	0.02
28	600682	南京新百	2,300	23,138.00	0.02
29	603115	海星股份	1,600	22,224.00	0.02
30	300759	康龙化成	100	21,699.00	0.02
31	600017	日照港	8,100	21,627.00	0.02
32	601169	北京银行	4,400	21,428.00	0.02
33	002232	启明信息	1,800	21,276.00	0.02
34	601198	东兴证券	1,900	20,767.00	0.02
35	002217	合力泰	5,800	20,706.00	0.02
36	002813	路畅科技	800	20,632.00	0.02
37	000968	蓝焰控股	3,200	20,544.00	0.02
38	002847	盐津铺子	200	19,944.00	0.02
39	600642	申能股份	3,200	19,648.00	0.02
40	002500	山西证券	2,900	19,459.00	0.02
41	300347	泰格医药	100	19,330.00	0.02
42	600967	内蒙一机	1,900	19,228.00	0.02
43	002402	和而泰	800	19,176.00	0.02
44	600482	中国动力	1,100	19,162.00	0.02
45	002940	昂利康	500	18,640.00	0.02
46	002109	兴化股份	3,800	18,202.00	0.02
47	002442	龙星化工	2,900	18,096.00	0.02
48	002945	华林证券	1,300	17,966.00	0.02
49	002038	双鹭药业	1,700	17,901.00	0.02
50	002850	科达利	200	17,480.00	0.02
51	300628	亿联网络	200	16,760.00	0.01
52	600064	南京高科	1,800	16,722.00	0.01
53	600583	海油工程	3,700	16,650.00	0.01
54	002189	中光学	1,000	16,250.00	0.01
55	002214	大立科技	800	15,312.00	0.01
56	605123	派克新材	200	15,240.00	0.01
57	300741	华宝股份	300	15,216.00	0.01
58	300601	康泰生物	100	14,900.00	0.01
59	600343	航天动力	1,500	14,835.00	0.01
60	601857	中国石油	2,800	14,812.00	0.01
61	002842	翔鹭钨业	1,600	14,608.00	0.01
62	002783	凯龙股份	1,600	14,592.00	0.01
63	002128	露天煤业	1,400	14,574.00	0.01
64	002863	今飞凯达	2,900	14,558.00	0.01

65	002328	新朋股份	3,000	14,220.00	0.01
66	300573	兴齐眼药	100	14,103.00	0.01
67	000800	一汽解放	1,300	14,066.00	0.01
68	000796	凯撒旅业	1,500	14,025.00	0.01
69	002204	大连重工	3,800	13,946.00	0.01
70	000987	越秀金控	1,100	13,926.00	0.01
71	300005	探路者	1,400	13,734.00	0.01
72	000701	厦门信达	2,400	13,704.00	0.01
73	603686	龙马环卫	900	13,689.00	0.01
74	603339	四方科技	1,400	13,342.00	0.01
75	603037	凯众股份	800	13,256.00	0.01
76	600081	东风科技	900	13,212.00	0.01
77	600104	上汽集团	600	13,182.00	0.01
78	603629	利通电子	600	13,074.00	0.01
79	300177	中海达	1,300	12,818.00	0.01
80	002448	中原内配	2,100	12,810.00	0.01
81	000088	盐田港	2,300	12,742.00	0.01
82	600820	隧道股份	2,400	12,696.00	0.01
83	600717	天津港	3,120	12,230.40	0.01
84	603358	华达科技	700	12,159.00	0.01
85	603315	福鞍股份	1,000	12,000.00	0.01
86	002839	张家港行	2,200	11,968.00	0.01
87	300249	依米康	1,700	11,917.00	0.01
88	300226	上海钢联	200	11,910.00	0.01
89	002756	永兴材料	200	11,878.00	0.01
90	601339	百隆东方	2,200	11,858.00	0.01
91	601006	大秦铁路	1,800	11,844.00	0.01
92	300594	朗进科技	600	11,736.00	0.01
93	002925	盈趣科技	300	11,673.00	0.01
94	600458	时代新材	1,400	11,662.00	0.01
95	603277	银都股份	500	11,625.00	0.01
96	600170	上海建工	4,200	11,592.00	0.01
97	001965	招商公路	1,600	11,552.00	0.01
98	300778	新城市	600	11,514.00	0.01
99	605369	拱东医疗	100	11,502.00	0.01
100	000507	珠海港	1,900	11,495.00	0.01
101	600742	一汽富维	1,100	11,209.00	0.01
102	600486	扬农化工	100	11,177.00	0.01
103	300032	金龙机电	2,200	11,176.00	0.01

104	002250	联化科技	400	11,160.00	0.01
105	601228	广州港	3,500	11,130.00	0.01
106	600269	赣粤高速	3,300	11,088.00	0.01
107	000061	农产品	2,000	11,040.00	0.01
108	603378	亚士创能	200	11,004.00	0.01
109	002538	司尔特	1,600	10,960.00	0.01
110	000957	中通客车	1,800	10,944.00	0.01
111	600075	新疆天业	1,600	10,880.00	0.01
112	000429	粤高速 A	1,500	10,755.00	0.01
113	300197	节能铁汉	3,500	10,745.00	0.01
114	300681	英搏尔	300	10,737.00	0.01
115	600893	航发动力	200	10,638.00	0.01
116	002042	华孚时尚	2,200	10,626.00	0.01
117	601860	紫金银行	2,900	10,527.00	0.01
118	603323	苏农银行	2,400	10,512.00	0.01
119	300401	花园生物	800	10,440.00	0.01
120	002948	青岛银行	2,100	10,437.00	0.01
121	601827	三峰环境	1,100	10,417.00	0.01
122	300396	迪瑞医疗	500	10,415.00	0.01
123	601965	中国汽研	600	10,368.00	0.01
124	002786	银宝山新	1,400	10,290.00	0.01
125	300780	德恩精工	700	10,234.00	0.01
126	603167	渤海轮渡	1,200	10,164.00	0.01
127	603118	共进股份	1,100	10,153.00	0.01
128	000823	超声电子	900	10,107.00	0.01
129	600970	中材国际	1,100	10,087.00	0.01
130	003001	中岩大地	400	10,080.00	0.01
131	300455	康拓红外	1,000	10,070.00	0.01
132	600523	贵航股份	700	10,024.00	0.01
133	000006	深振业 A	2,000	10,020.00	0.01
134	603613	国联股份	100	9,997.00	0.01
135	601512	中新集团	1,000	9,960.00	0.01
136	002930	宏川智慧	600	9,822.00	0.01
137	002729	好利来	200	9,810.00	0.01
138	603508	思维列控	500	9,805.00	0.01
139	002394	联发股份	1,200	9,804.00	0.01
140	600184	光电股份	900	9,783.00	0.01
141	600790	轻纺城	3,200	9,760.00	0.01
142	300635	中达安	500	9,745.00	0.01

143	002882	金龙羽	1,100	9,713.00	0.01
144	600502	安徽建工	2,500	9,700.00	0.01
145	002404	嘉欣丝绸	1,500	9,600.00	0.01
146	002251	步步高	1,300	9,568.00	0.01
147	603618	杭电股份	1,500	9,510.00	0.01
148	603808	歌力思	600	9,480.00	0.01
149	002298	中电兴发	1,300	9,282.00	0.01
150	000605	渤海股份	1,700	9,010.00	0.01
151	600261	阳光照明	2,300	8,993.00	0.01
152	002774	快意电梯	1,400	8,946.00	0.01
153	601086	国芳集团	2,300	8,924.00	0.01
154	603030	全筑股份	2,000	8,860.00	0.01
155	002519	银河电子	2,100	8,841.00	0.01
156	601500	通用股份	1,600	8,832.00	0.01
157	002033	丽江股份	1,400	8,820.00	0.01
157	002917	金奥博	1,000	8,820.00	0.01
158	600339	中油工程	3,100	8,804.00	0.01
159	600894	广日股份	1,300	8,736.00	0.01
160	002551	尚荣医疗	1,600	8,656.00	0.01
161	603180	金牌厨柜	180	8,584.20	0.01
162	300873	海晨股份	200	8,562.00	0.01
163	300643	万通智控	700	8,442.00	0.01
164	000042	中洲控股	1,000	8,430.00	0.01
165	002599	盛通股份	2,200	8,404.00	0.01
166	300100	双林股份	800	8,400.00	0.01
167	300277	海联讯	1,000	8,360.00	0.01
168	603861	白云电器	1,000	8,250.00	0.01
169	300660	江苏雷利	400	8,228.00	0.01
170	002376	新北洋	900	8,226.00	0.01
171	603158	腾龙股份	700	8,190.00	0.01
172	002628	成都路桥	2,400	8,184.00	0.01
173	600513	联环药业	900	8,172.00	0.01
174	603067	振华股份	1,100	8,162.00	0.01
175	300151	昌红科技	300	8,082.00	0.01
176	002801	微光股份	300	8,049.00	0.01
177	000561	烽火电子	1,200	8,028.00	0.01
178	002627	宜昌交运	1,300	8,008.00	0.01
179	300360	炬华科技	1,000	8,000.00	0.01
180	603012	创力集团	1,300	7,943.00	0.01



181	600435	北方导航	1,000	7,940.00	0.01
182	300174	元力股份	500	7,930.00	0.01
183	300341	麦克奥迪	900	7,884.00	0.01
184	002431	棕榈股份	2,700	7,857.00	0.01
185	600330	天通股份	800	7,848.00	0.01
185	603980	吉华集团	1,200	7,848.00	0.01
186	002112	三变科技	1,100	7,843.00	0.01
187	300653	正海生物	100	7,830.00	0.01
188	600611	大众交通	2,200	7,700.00	0.01
189	300855	图南股份	200	7,676.00	0.01
190	000923	河钢资源	400	7,628.00	0.01
191	002282	博深股份	700	7,623.00	0.01
192	300213	佳讯飞鸿	1,200	7,608.00	0.01
193	603681	永冠新材	300	7,560.00	0.01
194	603786	科博达	100	7,550.00	0.01
195	000551	创元科技	900	7,542.00	0.01
196	603021	山东华鹏	1,500	7,515.00	0.01
197	300605	恒锋信息	600	7,500.00	0.01
198	000809	铁岭新城	3,800	7,448.00	0.01
199	603580	艾艾精工	700	7,441.00	0.01
200	300011	鼎汉技术	1,300	7,410.00	0.01
201	000554	泰山石油	1,600	7,408.00	0.01
202	603590	康辰药业	200	7,378.00	0.01
203	002927	泰永长征	700	7,357.00	0.01
204	600824	益民集团	2,000	7,340.00	0.01
205	600468	百利电气	1,800	7,308.00	0.01
206	603186	华正新材	200	7,292.00	0.01
207	603586	金麒麟	600	7,242.00	0.01
208	603121	华培动力	700	7,224.00	0.01
209	600446	金证股份	500	7,220.00	0.01
209	603712	七一二	200	7,220.00	0.01
210	603979	金诚信	400	7,200.00	0.01
211	600299	安迪苏	600	7,176.00	0.01
212	601168	西部矿业	600	7,158.00	0.01
213	300099	精准信息	900	7,146.00	0.01
213	600826	兰生股份	900	7,146.00	0.01
214	300512	中亚股份	500	7,135.00	0.01
215	002663	普邦股份	4,000	7,120.00	0.01
216	603238	诺邦股份	300	7,080.00	0.01

217	002441	众业达	900	7,056.00	0.01
218	300644	南京聚隆	200	7,018.00	0.01
219	002391	长青股份	1,000	7,010.00	0.01
220	300188	美亚柏科	400	6,960.00	0.01
221	000850	华茂股份	1,900	6,954.00	0.01
222	002494	华斯股份	1,900	6,916.00	0.01
223	002942	新农股份	300	6,909.00	0.01
224	000068	华控赛格	2,500	6,775.00	0.01
225	002949	华阳国际	400	6,760.00	0.01
225	603166	福达股份	1,000	6,760.00	0.01
226	603677	奇精机械	600	6,750.00	0.01
227	603982	泉峰汽车	400	6,736.00	0.01
228	002634	棒杰股份	1,100	6,721.00	0.01
229	002060	粤水电	1,900	6,631.00	0.01
230	002733	雄韬股份	400	6,624.00	0.01
231	002040	南京港	1,100	6,622.00	0.01
232	300669	沪宁股份	300	6,615.00	0.01
233	603008	喜临门	200	6,602.00	0.01
234	603989	艾华集团	200	6,518.00	0.01
235	300563	神宇股份	400	6,496.00	0.01
236	605338	巴比食品	200	6,466.00	0.01
237	002231	奥维通信	1,200	6,432.00	0.01
238	000666	经纬纺机	800	6,376.00	0.01
239	300665	飞鹿股份	700	6,370.00	0.01
240	600706	曲江文旅	900	6,363.00	0.01
241	300625	三雄极光	400	6,348.00	0.01
242	002236	大华股份	300	6,330.00	0.01
243	002953	日丰股份	420	6,312.60	0.01
244	603768	常青股份	400	6,296.00	0.01
245	002817	黄山胶囊	580	6,269.80	0.01
246	603011	合锻智能	1,300	6,266.00	0.01
247	000598	兴蓉环境	1,200	6,252.00	0.01
248	002815	崇达技术	500	6,240.00	0.01
249	600843	上工申贝	1,000	6,210.00	0.01
250	300092	科新机电	700	6,174.00	0.01
251	002836	新宏泽	700	6,097.00	0.01
252	600326	西藏天路	900	6,066.00	0.01
253	603889	新澳股份	1,100	6,061.00	0.01
254	300351	永贵电器	700	6,048.00	0.01

255	002879	长缆科技	400	6,020.00	0.01
256	603506	南都物业	420	6,018.60	0.01
257	002633	申科股份	800	6,008.00	0.01
258	002609	捷顺科技	600	6,006.00	0.01
259	600356	恒丰纸业	800	5,976.00	0.01
260	002546	新联电子	1,600	5,968.00	0.01
261	603036	如通股份	700	5,957.00	0.01
262	000025	特力 A	400	5,952.00	0.01
263	600602	云赛智联	1,000	5,930.00	0.01
264	002454	松芝股份	1,100	5,929.00	0.01
265	600163	中闽能源	1,200	5,928.00	0.01
265	603656	泰禾智能	400	5,928.00	0.01
266	603223	恒通股份	200	5,926.00	0.01
267	600785	新华百货	500	5,900.00	0.01
268	300091	金通灵	1,400	5,880.00	0.01
269	600287	江苏舜天	1,100	5,852.00	0.01
270	002871	伟隆股份	600	5,808.00	0.01
271	002566	益盛药业	700	5,761.00	0.01
272	002873	新天药业	300	5,757.00	0.01
273	600960	渤海汽车	1,400	5,726.00	0.01
274	000032	深桑达 A	300	5,709.00	0.01
275	002775	文科园林	1,300	5,668.00	0.01
276	600778	友好集团	1,400	5,614.00	0.00
277	603217	元利科技	200	5,572.00	0.00
278	600363	联创光电	200	5,570.00	0.00
279	300597	吉大通信	600	5,556.00	0.00
280	002357	富临运业	1,100	5,533.00	0.00
281	300492	华图山鼎	100	5,512.00	0.00
282	300534	陇神戎发	800	5,504.00	0.00
283	002267	陕天然气	800	5,496.00	0.00
284	000795	英洛华	1,100	5,489.00	0.00
285	300796	贝斯美	300	5,478.00	0.00
286	002492	恒基达鑫	1,000	5,460.00	0.00
286	002790	瑞尔特	1,000	5,460.00	0.00
287	002307	北新路桥	1,200	5,424.00	0.00
288	600125	铁龙物流	1,100	5,423.00	0.00
289	603308	应流股份	260	5,369.00	0.00
290	603813	原尚股份	400	5,368.00	0.00
291	603499	翔港科技	700	5,341.00	0.00

292	600719	大连热电	1,500	5,325.00	0.00
293	002363	隆基机械	1,100	5,324.00	0.00
294	000695	滨海能源	900	5,319.00	0.00
295	603386	广东骏亚	300	5,307.00	0.00
296	603006	联明股份	600	5,298.00	0.00
297	603709	中源家居	300	5,295.00	0.00
298	300443	金雷股份	200	5,292.00	0.00
298	603421	鼎信通讯	700	5,292.00	0.00
299	600386	北巴传媒	1,500	5,280.00	0.00
300	603773	沃格光电	200	5,274.00	0.00
301	603983	丸美股份	100	5,211.00	0.00
302	601801	皖新传媒	1,100	5,192.00	0.00
303	300585	奥联电子	400	5,168.00	0.00
304	300695	兆丰股份	100	5,151.00	0.00
305	002347	泰尔股份	1,200	5,124.00	0.00
306	002787	华源控股	900	5,121.00	0.00
307	000637	茂化实华	1,300	5,057.00	0.00
308	603356	华菱精工	500	5,040.00	0.00
309	600936	广西广电	1,700	5,032.00	0.00
310	002134	天津普林	600	5,004.00	0.00
311	600723	首商股份	600	4,950.00	0.00
312	603958	哈森股份	500	4,945.00	0.00
313	603997	继峰股份	600	4,932.00	0.00
314	603220	中贝通信	400	4,912.00	0.00
315	603567	珍宝岛	300	4,887.00	0.00
316	600853	龙建股份	2,000	4,880.00	0.00
317	300575	中旗股份	200	4,872.00	0.00
317	601869	长飞光纤	200	4,872.00	0.00
318	601698	中国卫通	300	4,857.00	0.00
319	002057	中钢天源	700	4,823.00	0.00
320	002467	二六三	1,100	4,818.00	0.00
321	000970	中科三环	500	4,775.00	0.00
322	000777	中核科技	400	4,768.00	0.00
323	300579	数字认证	100	4,747.00	0.00
324	603908	牧高笛	200	4,736.00	0.00
325	002401	中远海科	400	4,732.00	0.00
326	002855	捷荣技术	500	4,715.00	0.00
327	300075	数字政通	400	4,708.00	0.00
328	603556	海兴电力	400	4,688.00	0.00

329	605166	聚合顺	500	4,650.00	0.00
330	600969	郴电国际	700	4,627.00	0.00
331	300936	中英科技	100	4,612.00	0.00
332	300678	中科信息	200	4,532.00	0.00
333	603758	秦安股份	600	4,506.00	0.00
334	002322	理工环科	400	4,500.00	0.00
334	603585	苏利股份	300	4,500.00	0.00
335	002215	诺普信	800	4,496.00	0.00
336	300689	澄天伟业	100	4,483.00	0.00
337	002543	万和电气	600	4,470.00	0.00
337	300402	宝色股份	300	4,470.00	0.00
338	600396	金山股份	1,800	4,464.00	0.00
339	300518	盛讯达	100	4,452.00	0.00
340	000836	富通信息	1,900	4,446.00	0.00
341	601789	宁波建工	1,200	4,416.00	0.00
342	601002	晋亿实业	900	4,410.00	0.00
343	300047	天源迪科	600	4,380.00	0.00
343	600279	重庆港九	1,200	4,380.00	0.00
343	603286	日盈电子	300	4,380.00	0.00
344	002731	萃华珠宝	700	4,333.00	0.00
345	300679	电连技术	150	4,323.00	0.00
346	000973	佛塑科技	1,000	4,320.00	0.00
347	002116	中国海诚	700	4,312.00	0.00
348	300786	国林科技	200	4,310.00	0.00
349	300577	开润股份	200	4,286.00	0.00
350	600757	长江传媒	800	4,248.00	0.00
350	603161	科华控股	300	4,248.00	0.00
351	300808	久量股份	300	4,236.00	0.00
352	002528	英飞拓	1,100	4,235.00	0.00
353	002339	积成电子	700	4,221.00	0.00
354	600033	福建高速	1,600	4,208.00	0.00
355	002828	贝肯能源	500	4,205.00	0.00
356	603058	永吉股份	600	4,188.00	0.00
357	600235	民丰特纸	800	4,184.00	0.00
358	002150	通润装备	700	4,151.00	0.00
359	002718	友邦吊顶	300	4,140.00	0.00
360	603916	苏博特	200	4,128.00	0.00
361	600755	厦门国贸	500	4,105.00	0.00
362	002295	精艺股份	600	4,098.00	0.00

363	002912	中新赛克	100	4,097.00	0.00
364	300195	长荣股份	700	4,095.00	0.00
365	000417	合肥百货	900	4,086.00	0.00
366	300093	金刚玻璃	200	4,082.00	0.00
367	000421	南京公用	800	4,080.00	0.00
368	600697	欧亚集团	300	4,077.00	0.00
369	603009	北特科技	700	4,060.00	0.00
370	600533	栖霞建设	1,300	4,056.00	0.00
371	600594	益佰制药	700	4,032.00	0.00
372	601226	华电重工	1,000	4,020.00	0.00
373	601019	山东出版	700	4,018.00	0.00
374	603099	长白山	500	4,015.00	0.00
375	300536	农尚环境	300	4,011.00	0.00
376	002877	智能自控	600	4,008.00	0.00
377	300095	华伍股份	400	4,000.00	0.00
378	600051	宁波联合	600	3,996.00	0.00
379	300515	三德科技	400	3,980.00	0.00
380	000411	英特集团	300	3,966.00	0.00
381	601678	滨化股份	500	3,955.00	0.00
382	300113	顺网科技	300	3,882.00	0.00
383	002896	中大力德	200	3,874.00	0.00
384	300472	新元科技	400	3,860.00	0.00
385	603667	五洲新春	400	3,808.00	0.00
386	002527	新时达	500	3,805.00	0.00
387	600939	重庆建工	1,100	3,773.00	0.00
388	603917	合力科技	400	3,688.00	0.00
389	600793	宜宾纸业	300	3,681.00	0.00
390	300434	金石亚药	400	3,664.00	0.00
391	002144	宏达高科	400	3,656.00	0.00
391	002753	永东股份	400	3,656.00	0.00
392	002708	光洋股份	600	3,636.00	0.00
393	600560	金白天正	400	3,624.00	0.00
393	603045	福达合金	300	3,624.00	0.00
394	002837	英维克	200	3,618.00	0.00
395	603776	永安行	200	3,610.00	0.00
396	002246	北化股份	500	3,600.00	0.00
397	000985	大庆华科	300	3,597.00	0.00
398	002037	保利联合	600	3,582.00	0.00
399	601319	中国人保	600	3,558.00	0.00

400	603321	梅轮电梯	500	3,545.00	0.00
401	002666	德联集团	700	3,535.00	0.00
402	600623	华谊集团	400	3,524.00	0.00
403	603311	金海高科	300	3,510.00	0.00
404	002780	三夫户外	200	3,500.00	0.00
404	603535	嘉诚国际	100	3,500.00	0.00
405	002552	宝鼎科技	300	3,498.00	0.00
406	300499	高澜股份	400	3,480.00	0.00
407	002883	中设股份	300	3,438.00	0.00
408	601518	吉林高速	1,500	3,420.00	0.00
409	603679	华体科技	200	3,416.00	0.00
410	300640	德艺文创	500	3,405.00	0.00
411	002861	瀛通通讯	230	3,401.70	0.00
412	000514	渝开发	1,000	3,400.00	0.00
413	300165	天瑞仪器	700	3,388.00	0.00
414	300851	交大思诺	100	3,371.00	0.00
415	300654	世纪天鸿	400	3,328.00	0.00
416	000851	高鸿股份	500	3,325.00	0.00
417	002992	宝明科技	200	3,310.00	0.00
418	603197	保隆科技	100	3,289.00	0.00
419	002792	通宇通讯	200	3,266.00	0.00
420	603829	洛凯股份	300	3,240.00	0.00
421	002990	盛视科技	100	3,236.00	0.00
422	600491	龙元建设	600	3,228.00	0.00
423	000552	靖远煤电	1,100	3,223.00	0.00
424	300570	太辰光	200	3,200.00	0.00
425	603928	兴业股份	300	3,198.00	0.00
426	000632	三木集团	900	3,195.00	0.00
427	002191	劲嘉股份	300	3,192.00	0.00
428	002486	嘉麟杰	1,100	3,190.00	0.00
428	002860	星帅尔	200	3,190.00	0.00
429	002973	侨银股份	200	3,186.00	0.00
430	002963	豪尔赛	200	3,166.00	0.00
431	000833	粤桂股份	700	3,164.00	0.00
432	300730	科创信息	200	3,142.00	0.00
433	603602	纵横通信	300	3,135.00	0.00
434	002859	洁美科技	100	3,127.00	0.00
435	300531	优博讯	200	3,120.00	0.00
436	600490	鹏欣资源	800	3,080.00	0.00

437	300114	中航电测	200	3,040.00	0.00
438	603823	百合花	200	3,028.00	0.00
439	300148	天舟文化	900	3,024.00	0.00
440	600094	大名城	800	3,016.00	0.00
441	603496	恒为科技	200	2,978.00	0.00
442	300227	光韵达	300	2,970.00	0.00
443	600232	金鹰股份	600	2,958.00	0.00
444	002757	南兴股份	200	2,952.00	0.00
444	600054	黄山旅游	300	2,952.00	0.00
445	603331	百达精工	300	2,946.00	0.00
446	000020	深华发 A	300	2,943.00	0.00
447	002635	安洁科技	200	2,926.00	0.00
448	603093	南华期货	200	2,920.00	0.00
449	600629	华建集团	400	2,896.00	0.00
450	300483	首华燃气	200	2,884.00	0.00
451	002184	海得控制	235	2,869.35	0.00
452	603268	松发股份	200	2,868.00	0.00
453	603533	掌阅科技	100	2,850.00	0.00
453	603662	柯力传感	100	2,850.00	0.00
454	002561	徐家汇	400	2,848.00	0.00
455	300578	会畅通讯	100	2,843.00	0.00
455	603383	顶点软件	100	2,843.00	0.00
456	002465	海格通信	300	2,838.00	0.00
457	002224	三力士	600	2,832.00	0.00
458	600764	中国海防	100	2,830.00	0.00
459	002909	集泰股份	300	2,823.00	0.00
460	603390	通达电气	300	2,802.00	0.00
461	300857	协创数据	100	2,792.00	0.00
462	300749	顶固集创	300	2,781.00	0.00
463	002952	亚世光电	200	2,780.00	0.00
464	603090	宏盛股份	200	2,772.00	0.00
465	603289	泰瑞机器	300	2,769.00	0.00
466	000922	佳电股份	400	2,744.00	0.00
467	002209	达意隆	400	2,732.00	0.00
468	000601	韶能股份	500	2,730.00	0.00
469	600082	海泰发展	900	2,727.00	0.00
470	603819	神力股份	300	2,724.00	0.00
471	000404	长虹华意	700	2,716.00	0.00
472	603955	大千生态	200	2,710.00	0.00



473	000099	中信海直	400	2,704.00	0.00
474	002287	奇正藏药	100	2,697.00	0.00
475	600101	明星电力	500	2,680.00	0.00
476	603767	中马传动	400	2,672.00	0.00
477	000753	漳州发展	1,000	2,670.00	0.00
478	002671	龙泉股份	700	2,653.00	0.00
479	002899	英派斯	200	2,642.00	0.00
480	603040	新坐标	130	2,623.40	0.00
481	002485	希努尔	600	2,622.00	0.00
481	300428	立中集团	200	2,622.00	0.00
482	603029	天鹅股份	200	2,620.00	0.00
483	300111	向日葵	900	2,619.00	0.00
484	603578	三星新材	180	2,595.60	0.00
485	600148	长春一东	200	2,586.00	0.00
486	003015	日久光电	200	2,580.00	0.00
487	002674	兴业科技	200	2,570.00	0.00
488	603788	宁波高发	200	2,528.00	0.00
489	600114	东睦股份	300	2,517.00	0.00
490	600527	江南高纤	1,000	2,510.00	0.00
491	002981	朝阳科技	100	2,508.00	0.00
492	300097	智云股份	300	2,490.00	0.00
493	000819	岳阳兴长	400	2,476.00	0.00
494	603080	新疆火炬	200	2,462.00	0.00
495	600985	淮北矿业	200	2,442.00	0.00
495	603685	晨丰科技	200	2,442.00	0.00
496	300771	智莱科技	100	2,428.00	0.00
497	002689	远大智能	800	2,424.00	0.00
498	601177	杭齿前进	300	2,421.00	0.00
499	603700	宁水集团	100	2,419.00	0.00
500	300879	大叶股份	100	2,418.00	0.00
501	600463	空港股份	400	2,412.00	0.00
501	600647	同达创业	200	2,412.00	0.00
502	000715	中兴商业	500	2,410.00	0.00
503	603936	博敏电子	200	2,370.00	0.00
504	600162	香江控股	1,300	2,366.00	0.00
505	000937	冀中能源	600	2,358.00	0.00
506	600067	冠城大通	700	2,352.00	0.00
507	605399	晨光新材	100	2,351.00	0.00
508	300210	森远股份	600	2,328.00	0.00

509	002327	富安娜	300	2,322.00	0.00
510	603106	恒银科技	400	2,304.00	0.00
511	600605	汇通能源	280	2,296.00	0.00
512	601137	博威合金	200	2,294.00	0.00
513	002576	通达动力	200	2,288.00	0.00
514	000880	潍柴重机	300	2,280.00	0.00
515	002297	博云新材	300	2,277.00	0.00
516	603320	迪贝电气	200	2,264.00	0.00
517	600665	天地源	700	2,254.00	0.00
518	002106	莱宝高科	200	2,250.00	0.00
519	300065	海兰信	200	2,234.00	0.00
520	603081	大丰实业	200	2,212.00	0.00
521	002868	绿康生化	200	2,190.00	0.00
522	601199	江南水务	600	2,178.00	0.00
523	002823	凯中精密	200	2,176.00	0.00
524	002054	德美化工	200	2,170.00	0.00
524	002999	天禾股份	280	2,170.00	0.00
525	002796	世嘉科技	200	2,162.00	0.00
525	603192	汇得科技	100	2,162.00	0.00
526	002961	瑞达期货	100	2,132.00	0.00
527	002779	中坚科技	200	2,126.00	0.00
528	300583	赛托生物	100	2,125.00	0.00
529	002303	美盈森	600	2,106.00	0.00
530	605277	新亚电子	100	2,103.00	0.00
531	000936	华西股份	300	2,100.00	0.00
532	002277	友阿股份	600	2,076.00	0.00
533	002062	宏润建设	500	2,070.00	0.00
534	601606	长城军工	200	2,066.00	0.00
535	603790	雅运股份	200	2,052.00	0.00
536	603199	九华旅游	100	2,017.00	0.00
537	002571	德力股份	300	2,004.00	0.00
538	603178	圣龙股份	200	2,002.00	0.00
539	000905	厦门港务	300	1,998.00	0.00
540	002807	江阴银行	500	1,970.00	0.00
540	002809	红墙股份	200	1,970.00	0.00
541	300652	雷迪克	100	1,966.00	0.00
542	300698	万马科技	100	1,932.00	0.00
543	002406	远东传动	300	1,929.00	0.00
544	300478	杭州高新	200	1,922.00	0.00

545	002915	中欣氟材	100	1,916.00	0.00
546	601968	宝钢包装	200	1,912.00	0.00
547	300609	汇纳科技	100	1,909.00	0.00
548	603948	建业股份	100	1,902.00	0.00
549	000548	湖南投资	500	1,890.00	0.00
550	600250	南纺股份	400	1,888.00	0.00
551	300380	安硕信息	100	1,887.00	0.00
552	600736	苏州高新	400	1,880.00	0.00
553	300069	金利华电	100	1,877.00	0.00
554	600770	综艺股份	300	1,869.00	0.00
555	600097	开创国际	200	1,850.00	0.00
556	300289	利德曼	300	1,845.00	0.00
557	601107	四川成渝	600	1,836.00	0.00
558	603956	威派格	100	1,830.00	0.00
559	300772	运达股份	100	1,821.00	0.00
560	300016	北陆药业	200	1,812.00	0.00
561	002644	佛慈制药	200	1,800.00	0.00
562	300626	华瑞股份	200	1,794.00	0.00
563	300798	锦鸡股份	200	1,792.00	0.00
564	600367	红星发展	200	1,790.00	0.00
564	600455	博通股份	100	1,790.00	0.00
565	300232	洲明科技	200	1,786.00	0.00
566	002971	和远气体	100	1,750.00	0.00
567	600218	全柴动力	200	1,736.00	0.00
568	002682	龙洲股份	500	1,730.00	0.00
569	002503	搜于特	1,100	1,727.00	0.00
570	603079	圣达生物	100	1,707.00	0.00
571	600351	亚宝药业	300	1,698.00	0.00
572	000677	恒天海龙	600	1,692.00	0.00
572	603332	苏州龙杰	100	1,692.00	0.00
573	300645	正元智慧	100	1,685.00	0.00
574	002253	川大智胜	100	1,678.00	0.00
575	601929	吉视传媒	900	1,665.00	0.00
576	600561	江西长运	400	1,664.00	0.00
577	600897	厦门空港	100	1,662.00	0.00
578	000767	晋控电力	500	1,650.00	0.00
579	600973	宝胜股份	400	1,648.00	0.00
579	601007	金陵饭店	200	1,648.00	0.00
580	603086	先达股份	180	1,645.20	0.00

581	000520	长航凤凰	500	1,635.00	0.00
582	002943	宇晶股份	100	1,630.00	0.00
583	000537	广宇发展	300	1,569.00	0.00
584	603926	铁流股份	100	1,564.00	0.00
585	601900	南方传媒	200	1,560.00	0.00
586	000952	广济药业	200	1,558.00	0.00
587	000089	深圳机场	200	1,554.00	0.00
587	300440	运达科技	200	1,554.00	0.00
588	002484	江海股份	100	1,548.00	0.00
589	002788	鹭燕医药	200	1,530.00	0.00
589	603227	雪峰科技	300	1,530.00	0.00
590	605255	天普股份	100	1,505.00	0.00
591	002228	合兴包装	400	1,500.00	0.00
592	000023	深天地 A	100	1,499.00	0.00
593	300452	山河药辅	100	1,492.00	0.00
594	603328	依顿电子	200	1,490.00	0.00
594	603569	长久物流	200	1,490.00	0.00
595	603003	龙宇燃油	200	1,456.00	0.00
596	603607	京华激光	100	1,454.00	0.00
597	002852	道道全	100	1,451.00	0.00
598	603123	翠微股份	200	1,450.00	0.00
599	300041	回天新材	100	1,445.00	0.00
600	603668	天马科技	200	1,442.00	0.00
601	603968	醋化股份	100	1,435.00	0.00
602	603365	水星家纺	100	1,431.00	0.00
603	300254	仟源医药	200	1,428.00	0.00
603	600361	华联综超	400	1,428.00	0.00
604	603949	雪龙集团	100	1,418.00	0.00
605	600190	锦州港	500	1,405.00	0.00
606	600928	西安银行	300	1,398.00	0.00
607	603660	苏州科达	200	1,392.00	0.00
608	000419	通程控股	300	1,332.00	0.00
609	002380	科远智慧	100	1,308.00	0.00
610	600099	林海股份	200	1,290.00	0.00
611	000888	峨眉山 A	200	1,282.00	0.00
612	002693	双成药业	300	1,281.00	0.00
613	002130	沃尔核材	200	1,278.00	0.00
613	002962	五方光电	100	1,278.00	0.00
614	002698	博实股份	100	1,273.00	0.00

615	603038	华立股份	100	1,271.00	0.00
616	300150	世纪瑞尔	300	1,254.00	0.00
616	600626	申达股份	300	1,254.00	0.00
617	600405	动力源	200	1,206.00	0.00
618	300435	中泰股份	100	1,205.00	0.00
619	000859	国风塑业	200	1,186.00	0.00
620	002278	神开股份	200	1,184.00	0.00
621	002782	可立克	100	1,171.00	0.00
622	002115	三维通信	200	1,142.00	0.00
623	300200	高盟新材	100	1,139.00	0.00
624	002657	中科金财	100	1,136.00	0.00
625	002771	真视通	100	1,125.00	0.00
626	601686	友发集团	100	1,116.00	0.00
627	603680	今创集团	100	1,115.00	0.00
628	603117	万林物流	300	1,095.00	0.00
629	600769	祥龙电业	200	1,086.00	0.00
630	600495	晋西车轴	300	1,083.00	0.00
631	300732	设研院	100	1,082.00	0.00
632	002686	亿利达	200	1,078.00	0.00
633	300050	世纪鼎利	200	1,076.00	0.00
634	603269	海鸥股份	100	1,066.00	0.00
635	600828	茂业商业	300	1,062.00	0.00
636	002350	北京科锐	200	1,060.00	0.00
637	002579	中京电子	100	1,055.00	0.00
638	002820	桂发祥	100	1,052.00	0.00
639	603133	碳元科技	100	1,034.00	0.00
640	000678	襄阳轴承	200	1,024.00	0.00
640	603798	康普顿	100	1,024.00	0.00
641	002806	华锋股份	100	996.00	0.00
642	600159	大龙地产	400	992.00	0.00
643	002587	奥拓电子	200	982.00	0.00
644	600266	城建发展	200	948.00	0.00
645	601116	三江购物	100	931.00	0.00
646	300532	今天国际	100	914.00	0.00
647	300112	万讯自控	100	907.00	0.00
648	300084	海默科技	200	904.00	0.00
649	000590	启迪药业	100	872.00	0.00
650	000810	创维数字	100	851.00	0.00
651	601333	广深铁路	400	848.00	0.00

652	000599	青岛双星	200	834.00	0.00
653	002550	千红制药	200	820.00	0.00
654	002344	海宁皮城	200	814.00	0.00
655	002432	九安医疗	100	748.00	0.00
656	002593	日上集团	200	744.00	0.00
657	002936	郑州银行	200	734.00	0.00
658	601008	连云港	200	732.00	0.00
659	603725	天安新材	100	727.00	0.00
660	600633	浙数文化	100	718.00	0.00
661	600854	春兰股份	200	698.00	0.00
662	000622	恒立实业	200	692.00	0.00
663	601068	中铝国际	200	690.00	0.00
664	600128	弘业股份	100	686.00	0.00
665	603015	弘讯科技	100	681.00	0.00
666	002559	亚威股份	100	667.00	0.00
667	600135	乐凯胶片	100	654.00	0.00
667	601616	广电电气	200	654.00	0.00
668	603682	锦和商业	100	648.00	0.00
669	600558	大西洋	200	636.00	0.00
670	002748	世龙实业	100	630.00	0.00
671	600838	上海九百	100	620.00	0.00
672	002337	赛象科技	200	616.00	0.00
673	002702	海欣食品	100	604.00	0.00
674	600692	亚通股份	100	593.00	0.00
675	603183	建研院	100	557.00	0.00
676	002161	远望谷	100	548.00	0.00
677	600613	神奇制药	100	536.00	0.00
678	603101	汇嘉时代	100	498.00	0.00
679	601588	北辰实业	200	468.00	0.00
680	002495	佳隆股份	200	464.00	0.00
681	002691	冀凯股份	100	420.00	0.00
682	000757	浩物股份	100	391.00	0.00
683	002491	通鼎互联	100	388.00	0.00
684	600791	京能置业	100	344.00	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	600893	航发动力	743,930.00	0.73
2	000651	格力电器	658,038.00	0.65
3	601919	中远海控	643,154.00	0.63
4	600999	招商证券	630,939.00	0.62
5	600519	贵州茅台	606,967.00	0.60
6	300677	英科医疗	570,031.00	0.56
7	600760	中航沈飞	548,701.00	0.54
8	002304	洋河股份	518,440.00	0.51
9	603259	药明康德	506,940.00	0.50
10	600000	浦发银行	494,169.00	0.49
11	603501	韦尔股份	486,182.00	0.48
12	600584	长电科技	473,795.00	0.47
13	600048	保利地产	469,251.60	0.46
14	000333	美的集团	466,433.20	0.46
15	600436	片仔癀	461,136.00	0.45
16	601888	中国中免	452,248.00	0.44
17	002714	牧原股份	451,683.00	0.44
18	000100	TCL 科技	449,451.00	0.44
19	000063	中兴通讯	446,610.00	0.44
20	603986	兆易创新	437,173.00	0.43

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	600519	贵州茅台	823,010.00	0.81
2	603259	药明康德	801,228.60	0.79
3	600893	航发动力	728,306.00	0.72
4	300677	英科医疗	644,600.00	0.63
5	600000	浦发银行	632,184.00	0.62
6	002304	洋河股份	626,645.00	0.62
7	601919	中远海控	624,496.00	0.61
8	000651	格力电器	622,525.00	0.61
9	603986	兆易创新	619,827.00	0.61

10	601888	中国中免	615,730.00	0.60
11	600999	招商证券	591,503.00	0.58
12	600760	中航沈飞	560,111.00	0.55
13	000100	TCL 科技	551,718.00	0.54
14	600584	长电科技	549,670.00	0.54
15	600436	片仔癀	545,835.00	0.54
16	300760	迈瑞医疗	520,246.00	0.51
17	002714	牧原股份	517,845.00	0.51
18	000333	美的集团	513,983.00	0.50
19	603501	韦尔股份	507,414.00	0.50
20	300759	康龙化成	506,416.00	0.50

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	75,606,982.67
卖出股票收入（成交）总额	90,172,206.09

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,164,000.00	44.60
	其中：政策性金融债	50,164,000.00	44.60
4	企业债券	26,694,100.00	23.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	33,388,000.00	29.69
7	可转债（可交换债）	11,831,063.20	10.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	122,077,163.20	108.54

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------



1	210205	21 国开 05	100,000	10,125,000.00	9.00
2	210203	21 国开 03	100,000	10,029,000.00	8.92
3	210202	21 国开 02	100,000	10,009,000.00	8.90
4	210206	21 国开 06	100,000	10,001,000.00	8.89
5	210207	21 国开 07	100,000	10,000,000.00	8.89

### 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国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货操作整体谨慎，通过严控持仓规模和持仓期限，有效控制风险。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债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）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-222,952.91
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内参与国债期货投资，操作整体谨慎，通过严控持仓规模和持仓期限，有效控制风险。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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，国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会行政处罚，罚款合计 4880 万元。主要违法违规事实：（一）为违规的政府购买服务项目提供融资；（二）项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；（三）违规变相发放土地储备贷款；（四）设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；

(五) 贷款风险分类不准确；(六) 向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；(七) 违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；(八) 向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；(九) 扶贫贷款存贷挂钩；(十) 易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；(十一) 未落实同业业务交易对手名单制监管要求；(十二) 以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；(十三) 以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；(十四) 风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；(十五) 未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；(十六) 逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；(十七) 利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；(十八) 违规收取小微企业贷款承诺费；(十九) 收取财务顾问费质价不符；(二十) 利用银团贷款承诺费浮利分费；(二十一) 向检查组提供虚假整改说明材料；(二十二) 未如实提供信贷资产转让台账；(二十三) 案件信息迟报、瞒报；(二十四) 对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。

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。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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	48,875.59
2	应收证券清算款	1,056,865.88
3	应收股利	-
4	应收利息	1,251,241.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,356,982.83

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	---------------

1	123058	欣旺转债	1,638,170.00	1.46
2	110043	无锡转债	1,577,520.00	1.40
3	110059	浦发转债	1,536,450.00	1.37
4	113013	国君转债	1,511,654.00	1.34
5	110045	海澜转债	1,265,884.20	1.13
6	113011	光大转债	1,155,800.00	1.03
7	113611	福 20 转债	430,225.00	0.38

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

#### 7.11.6 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
194	554,583.77	98,027,674.85	91.11%	9,561,577.30	8.89%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	973.98	0.0009%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,703,333.61	9.95	10,000,600.00	9.30	3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	3年
基金经理等人员	-	-	-	-	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	3年
其他	-	-	-	-	3年
合计	10,703,333.61	9.95	10,000,600.00	9.30	3年

注：本基金成立后有 10,000,600.00 份额为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 3 年，自 2018 年 11 月 2 日起至 2021 年 11 月 1 日止。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年11月2日）基金份额总额	150,011,600.00
本报告期期初基金份额总额	99,977,493.27
本报告期基金总申购份额	43,575,851.07
减：本报告期基金总赎回份额	35,964,092.19
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	107,589,252.15

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	96,870,931.55	58.43%	70,841.98	58.43%	-
华创证券	1	68,908,257.21	41.57%	50,393.46	41.57%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；

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

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	50,576,219.55	26.25%	152,135,000.00	8.44%	-	-
华创证券	142,083,260.61	73.75%	1,651,300,000.00	91.56%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 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	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日
4	国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 2 日
5	国金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
6	国金量化添利定期开放债券型发	指定披露媒体和本	2021 年 4 月 20 日

	起式证券投资基金基金合同	基金基金管理人网站	
7	国金量化添利定期开放债券型发起式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	国金量化添利定期开放债券型发起式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	国金量化添利定期开放债券型发起式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	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 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
13	关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 6 月 10 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及基金份额累计净值，基金封闭期内至少每周公告 1 次基金的份额净值和份额累计净值。



## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年1月1日-2021年6月20日	20,003,800.00	-	-	20,003,800.00	18.59%
	2	2021年6月18日-2021年6月30日	-	24,235,579.25	-	24,235,579.25	22.53%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 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、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化添利定期开放债券型发起式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