

# 国金量化精选混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	76
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	76
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	76
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
8.12 投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	78
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	78
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>78</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	79
11.4 基金投资策略的改变 .....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8 其他重大事件 .....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化精选混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化精选	
基金主代码	014805	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 18 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	493,569,785.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化精选 A	国金量化精选 C
下属分级基金的交易代码	014805	014806
报告期末下属分级基金的份额总额	90,987,074.75 份	402,582,710.38 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过量化方法综合考虑标的中长期的表现，优选具有超额收益的个股构建投资组合，力求为基金份额持有人获取持续稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金“自上而下”构建选股模型，在风险模型约束下，紧密跟踪基准，严格控制运作风险，并根据各个子模型一定时期内的表现情况对其迭代，提高整体模型的适应能力，目标取得持续稳定的超额收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国金基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽
	联系电话	010-88005632
	电子邮箱	zhangli@gfund.com
客户服务电话	4000-2000-18	95568
传真	010-88005666	010-57093382
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100089	100031

法定代表人	邵海波	高迎欣
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年3月18日(基金合同生效日)-2022年12月31日	
	国金量化精选 A	国金量化精选 C
本期已实现收益	11,309,333.27	12,914,696.03
本期利润	10,260,118.86	-184,731.61
加权平均基金份额本期利润	0.1412	-0.0010
本期加权平均净值利润率	12.62%	-0.08%
本期基金份额净值增长率	19.53%	19.06%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	
期末可供分配利润	17,767,864.07	76,732,061.38
期末可供分配基金份额利润	0.1953	0.1906
期末基金资产净值	108,754,938.82	479,314,771.76
期末基金份额净值	1.1953	1.1906
3.1.3 累计期末指标	2022年末	
基金份额累计净值增长率	19.53%	19.06%

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。

4. 本基金合同自 2022 年 3 月 18 日起生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化精选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.44%	1.05%	2.13%	0.82%	8.31%	0.23%
过去六个月	4.69%	1.15%	-6.98%	0.88%	11.67%	0.27%
自基金合同生效起至今	19.53%	1.06%	-4.37%	1.05%	23.90%	0.01%

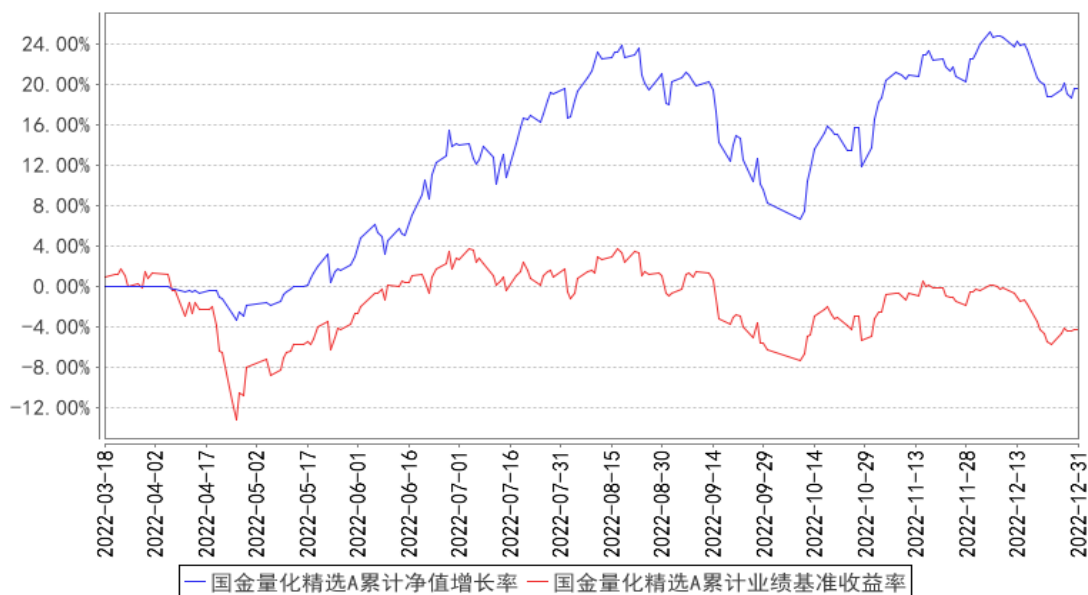
国金量化精选 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.30%	1.05%	2.13%	0.82%	8.17%	0.23%
过去六个月	4.43%	1.15%	-6.98%	0.88%	11.41%	0.27%
自基金合同生效起至今	19.06%	1.06%	-4.37%	1.05%	23.43%	0.01%

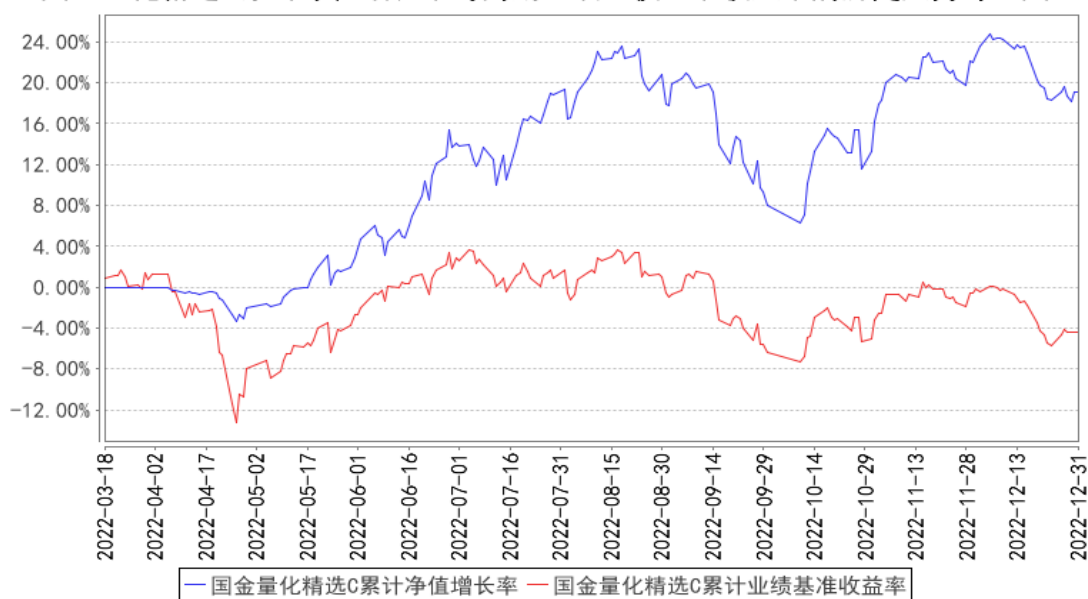
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

### 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

国金量化精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国金量化精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



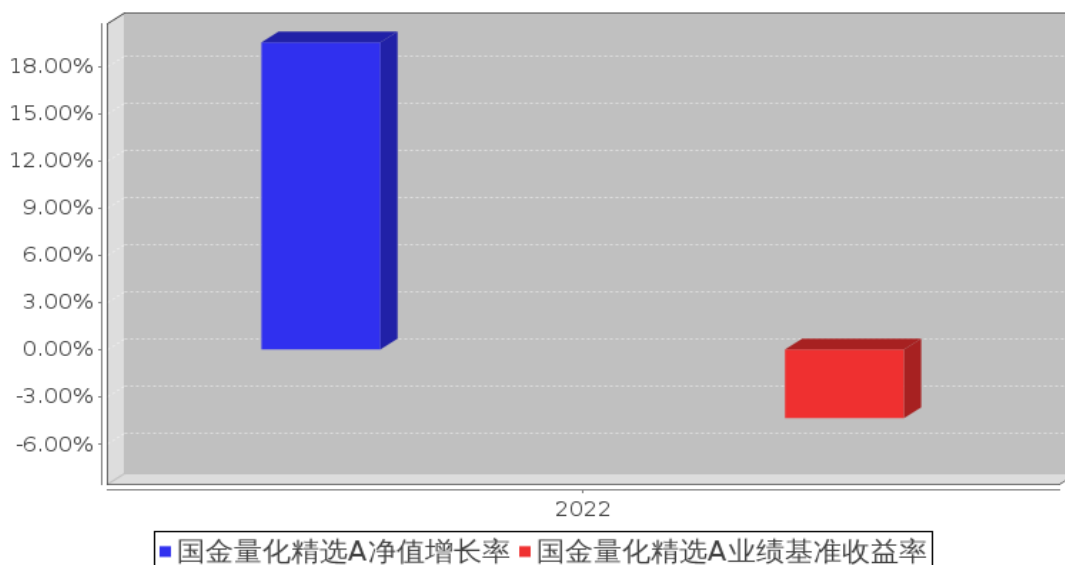
注：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2022 年 3 月 18 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。

2、本基金建仓期为 2022 年 3 月 18 日至 2022 年 9 月 17 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

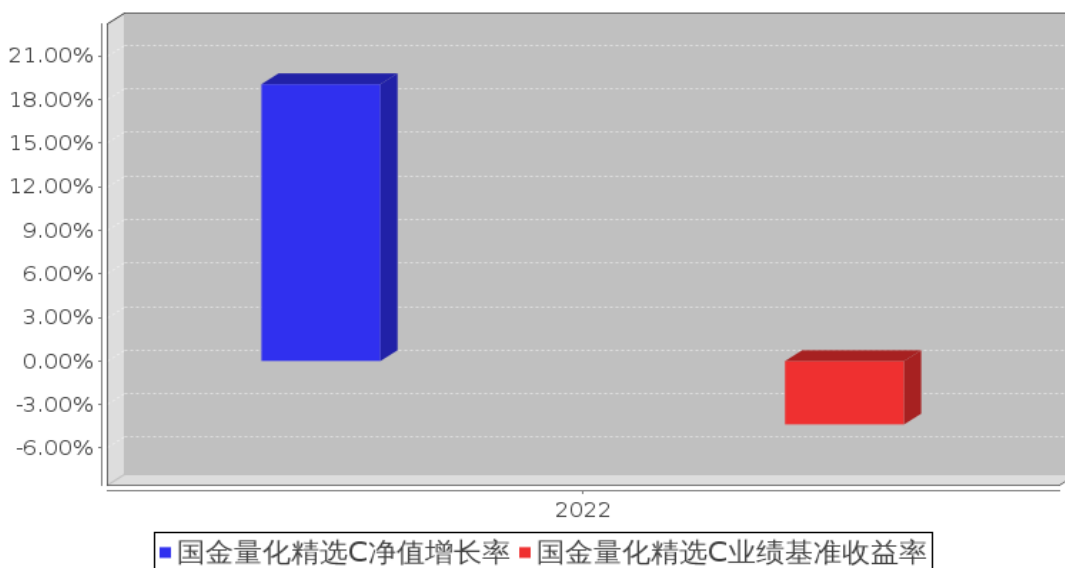


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化精选A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国金量化精选C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2022 年 3 月 18 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至2022年12月31日，国金基金管理有限公司共管理26只公募基金，具体包括国金金腾货币市场证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金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、国金惠诚债券型证券投资基金、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2022年3月18日	-	6年	马芳女士，中国人民大学硕士，2003年7月至2016年5月历任华泰贝通网络科技有限公司担任IT事业部测试工程师，奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理，2016年5月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心

					副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资事业部副总经理。
--	--	--	--	--	------------------------------

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期填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》《国金量化精选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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向

交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年从市场环境看，整体相对均衡，机会分散，一定程度上适合量化投资获取超额收益。因子层面：市值方面整体小票占优，动量除四季度外整体延续性较好。市场波动方面，前三季度市场波动相对较大，四季度以来整体处于全年较低水平。行业涨跌方面，为数不多的几个上涨行业包括煤炭、消费者服务、交通运输等，电子、综合金融、计算机和国防军工等跌幅较大。国金量化精选混合型证券投资基金成立于 2022 年 3 月 18 日，4 月市场下行区间正处于建仓期。产品超额收益特征相对稳健，主要源于收益来源的多样化和分散的持仓风格。量化策略是不断储备和迭代优化的过程，目标是力争获取相对持续和稳健的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 1.1953 元，累计单位净值为 1.1953 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 19.53%，同期业绩比较基准增长率为-4.37%。

截至本报告期末，本基金 C 类份额单位净值为 1.1906 元，累计单位净值为 1.1906 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 19.06%，同期业绩比较基准增长率为-4.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场波动层面看，低波动环境已经持续了较长时间，波动恢复的概率增加；市场基本面环境看，以复苏为主要预期的市场环境使权益资产配置价值凸显，但具体的节奏与国内需求情况和国外主要经济体所处的周期等因素相关。整体看机会分散、相对均衡的市场环境一定程度上利于量化产品追求超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 164 项，涵盖公司主要业务范围。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

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

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 61004823_A02 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金量化精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金量化精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金量化精选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化精选混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职

	业道德守则，我们独立于国金量化精选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金量化精选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化精选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化精选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，</p>



	<p>根据获取的审计证据，就可能对国金量化精选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金量化精选混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺耀	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2023年03月30日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	46,720,480.10
结算备付金		4,400.58
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	480,440,024.40
其中：股票投资		480,440,024.40
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	68,092,898.64
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-

其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		3,311,248.88
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		598,569,052.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		9,296,417.66
应付管理人报酬		741,366.93
应付托管费		123,561.14
应付销售服务费		201,462.86
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	136,533.43
负债合计		10,499,342.02
<b>净资产:</b>		
实收基金	7.4.7.10	493,569,785.13
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	94,499,925.45
净资产合计		588,069,710.58
负债和净资产总计		598,569,052.60

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，国金量化精选 A 基金份额净值 1.1953 元，基金份额总额 90,987,074.75 份；国金量化精选 C 基金份额净值 1.1906 元，基金份额总额 402,582,710.38 份。国金量化精选份额总额合计为 493,569,785.13 份。

2. 本期财务报表的实际编制期间系 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止。

## 7.2 利润表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年3月18日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
<b>一、营业总收入</b>		15,231,199.91
1. 利息收入		375,289.79
其中：存款利息收入	7.4.7.13	201,825.16
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		173,464.63
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,710,131.86
其中：股票投资收益	7.4.7.14	26,869,644.70
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	840,487.16
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	7.4.7.20	-14,148,642.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,294,420.31
<b>减：二、营业总支出</b>		5,155,812.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,558,102.24
2. 托管费	7.4.10.2.2	593,017.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	865,497.54
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	139,195.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）</b>		10,075,387.25
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,075,387.25
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		10,075,387.25

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	218,397,464.38	-	-	218,397,464.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	275,172,320.75	-	94,499,925.45	369,672,246.20
（一）、综合收益总额	-	-	10,075,387.25	10,075,387.25
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	275,172,320.75	-	84,424,538.20	359,596,858.95
其中：1. 基金申购款	854,387,148.48	-	169,916,837.11	1,024,303,985.59
2. 基金赎回款	-579,214,827.73	-	-85,492,298.91	-664,707,126.64
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	493,569,785.13	-	94,499,925.45	588,069,710.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邵海波</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国金量化精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2021]4097 号文《关于准予国金量化精选混合型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人国金基金管理有限公司于 2022 年 1 月 20 日到 2022 年 3 月 16 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2022) 验字第 61004823\_A02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料，基金合同于 2022 年 3 月 18 日正式生效。设立时，国金量化精选 A 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 86,296,247.96 元，折合 86,296,247.96 份国金量化精选 A 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 100,917.65 元，折合 100,917.65 份国金量化精选 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 86,397,165.61 元，折合 86,397,165.61 份国金量化精选 A 类基金份额。国金量化精选 C 类基金份额已收到首次募集的有效净认购金额为人民币 131,941,854.33 元，折合 131,941,854.33 份国金量化精选 C 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 58,444.44 元，折合 58,444.44 份国金量化精选 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 132,000,298.77 元，折合 132,000,298.77 份国金量化精选 C 类基金份额。国金量化精选 A 类基金份额和 C 类基金份额收到的实收基金合计人民币 218,397,464.38 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 218,397,464.38 份国金量化精选基金份额。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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、货币市场工具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。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例范围为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产分类

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

#### (2) 金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

化情况；

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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



本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期

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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

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

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

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

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

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	6,676,410.25
等于：本金	6,675,217.59
加：应计利息	1,192.66
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	40,044,069.85
等于：本金	40,039,369.17
加：应计利息	4,700.68
减：坏账准备	-
合计	46,720,480.10

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	494,588,666.45	-	480,440,024.40	-14,148,642.05
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	494,588,666.45	-	480,440,024.40	-14,148,642.05

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	68,092,898.64	-
银行间市场	-	-
合计	68,092,898.64	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

## 7.4.7.8 其他资产

注：无

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,533.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	135,000.00
合计	136,533.43

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 国金量化精选 A

项目	本期 2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	86,397,165.61	86,397,165.61
本期申购	113,145,303.48	113,145,303.48
本期赎回（以“-”号填列）	-108,555,394.34	-108,555,394.34
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	90,987,074.75	90,987,074.75

## 国金量化精选 C

项目	本期 2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	132,000,298.77	132,000,298.77
本期申购	741,241,845.00	741,241,845.00
本期赎回（以“-”号填列）	-470,659,433.39	-470,659,433.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	402,582,710.38	402,582,710.38

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金合同生效日为2022年3月18日。

3. 本基金设立时，国金量化精选 A 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 86,296,247.96 元，折合 86,296,247.96 份国金量化精选 A 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 100,917.65 元，折合 100,917.65 份国金量化精选 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 86,397,165.61 元，折合 86,397,165.61 份国金量化精选 A 类基金份额。国金量化精选 C 类基金份额已收到首次募集的有效净认购金额为人民币 131,941,854.33 元，折合 131,941,854.33 份国金量化精选 C 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 58,444.44 元，折合 58,444.44 份国金量化精选 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 132,000,298.77 元，折合 132,000,298.77 份国金量化精选 C 类基金份额。国金量化精选 A 类基金份额和 C 类基金份额收到的实收基金合计人民币 218,397,464.38 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 218,397,464.38 份国金量化精选基金份额。



## 7.4.7.11 其他综合收益

注：无

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金量化精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,309,333.27	-1,049,214.41	10,260,118.86
本期基金份额交易产生的变动数	6,743,724.06	764,021.15	7,507,745.21
其中：基金申购款	20,779,764.07	1,443,898.06	22,223,662.13
基金赎回款	-14,036,040.01	-679,876.91	-14,715,916.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,053,057.33	-285,193.26	17,767,864.07

国金量化精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	12,914,696.03	-13,099,427.64	-184,731.61
本期基金份额交易产生的变动数	65,077,943.64	11,838,849.35	76,916,792.99
其中：基金申购款	136,377,873.13	11,315,301.85	147,693,174.98
基金赎回款	-71,299,929.49	523,547.50	-70,776,381.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,992,639.67	-1,260,578.29	76,732,061.38

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	37,177.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	134,094.32
结算备付金利息收入	30,553.36
其他	-
合计	201,825.16

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	26,869,644.70

股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	26,869,644.70

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,742,163,531.17
减：卖出股票成本总额	1,711,169,147.69
减：交易费用	4,124,738.78
买卖股票差价收入	26,869,644.70

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	840,487.16
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	840,487.16

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-14,148,642.05
股票投资	-14,148,642.05
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-14,148,642.05

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	1,294,132.12
基金转换费收入	288.19
合计	1,294,420.31

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	95,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	3,795.88
其他	400.00
合计	139,195.88

#### 7.4.7.24 分部报告

无

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东

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

注：1. 经国金基金管理有限公司股东会审议通过，公司股东涌金投资控股有限公司将其持有 2% 的股权转让给国金证券股份有限公司，公司已按照相关法律法规要求，完成相关备案及登记手续。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,558,102.24
其中：支付销售机构的客户维护费	1,008,907.69

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。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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、公休日等，支付日期顺延。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	593,017.00

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

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化精选 A	国金量化精选 C	合计
国金基金管理有限公司	-	86,780.16	86,780.16
国金证券股份有限公司	-	14,480.23	14,480.23

中国民生银行股份有限公司	-	5,593.20	5,593.20
合计	-	106,853.59	106,853.59

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无

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

注：无

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

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

注：无

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司-活期存款	6,676,410.25	37,177.48

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金于本报告期内未参与关联方承销期内承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

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
300850	新强联	2022 年 12 月 30 日	重大事项停牌	53.28	2023 年 01 月 10 日	56.88	3,800	207,595.00	202,464.00	-

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

注：无

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：无

**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结



果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

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

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

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

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	46,720,480.10	-	-	-	-	-	46,720,480.10
结算备付金	4,400.58	-	-	-	-	-	4,400.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-480,440,024.40	480,440,024.40
买入返售金融资产	68,092,898.64	-	-	-	-	-	68,092,898.64
应收申购款	-	-	-	-	-	3,311,248.88	3,311,248.88
资产总计	114,817,779.32	-	-	-	-	-483,751,273.28	598,569,052.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,296,417.66	9,296,417.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	741,366.93	741,366.93
应付托管费	-	-	-	-	-	123,561.14	123,561.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	201,462.86	201,462.86
其他负债	-	-	-	-	-	136,533.43	136,533.43
负债总计	-	-	-	-	-	10,499,342.02	10,499,342.02
利率敏感度缺口	114,817,779.32	-	-	-	-	-473,251,931.26	588,069,710.58

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

##### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	480,440,024.40	81.70
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	480,440,024.40	81.70

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

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数（000905.SH）变化 5%，其他变量不变；	
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2022年12月31日）
	+5%	17,228,970.29
	-5%	-17,228,970.29

##### 7.4.13.4.4 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。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日
第一层次	480,237,560.40
第二层次	202,464.00
第三层次	-
合计	480,440,024.40

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2023 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	480,440,024.40	80.26
	其中：股票	480,440,024.40	80.26
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	68,092,898.64	11.38
	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	46,724,880.68	7.81
8	其他各项资产	3,311,248.88	0.55
9	合计	598,569,052.60	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,493,156.80	0.93
B	采矿业	4,243,870.00	0.72
C	制造业	296,384,940.60	50.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供	3,057,483.00	0.52

	应业		
E	建筑业	12,633,082.00	2.15
F	批发和零售业	23,379,581.00	3.98
G	交通运输、仓储和邮政业	29,946,107.00	5.09
H	住宿和餐饮业	2,775,755.00	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,678,704.00	3.86
J	金融业	27,403,629.00	4.66
K	房地产业	11,487,642.00	1.95
L	租赁和商务服务业	13,699,124.00	2.33
M	科学研究和技术服务业	4,912,751.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	6,936,069.00	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	67,983.00	0.01
P	教育	2,382,558.00	0.41
Q	卫生和社会工作	75,399.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	12,733,564.00	2.17
S	综合	148,626.00	0.03
	合计	480,440,024.40	81.70

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600809	山西汾酒	19,500	5,557,305.00	0.95
2	600050	中国联通	1,221,400	5,471,872.00	0.93
3	600732	爱旭股份	144,300	5,457,426.00	0.93
4	601888	中国中免	25,100	5,422,353.00	0.92
5	002475	立讯精密	168,700	5,356,225.00	0.91
6	601668	中国建筑	975,900	5,299,137.00	0.90
7	000568	泸州老窖	22,000	4,934,160.00	0.84
8	300604	长川科技	108,900	4,854,762.00	0.83
9	600519	贵州茅台	2,600	4,490,200.00	0.76
10	600160	巨化股份	274,100	4,251,291.00	0.72
11	300260	新莱应材	59,800	4,012,580.00	0.68
12	000002	万科 A	198,200	3,607,240.00	0.61
13	000858	五粮液	18,100	3,270,489.00	0.56
14	000627	天茂集团	1,012,400	3,199,184.00	0.54
15	600768	宁波富邦	347,900	3,197,201.00	0.54
16	600438	通威股份	79,500	3,067,110.00	0.52
17	300144	宋城演艺	184,800	2,698,080.00	0.46
18	300769	德方纳米	11,138	2,557,173.42	0.43

19	300763	锦浪科技	14,000	2,520,700.00	0.43
20	000333	美的集团	48,500	2,512,300.00	0.43
21	300750	宁德时代	6,300	2,478,546.00	0.42
22	300717	华信新材	173,300	2,426,200.00	0.41
23	600481	双良节能	186,200	2,409,428.00	0.41
24	600235	民丰特纸	427,600	2,381,732.00	0.41
25	000001	平安银行	172,900	2,275,364.00	0.39
26	603876	鼎胜新材	54,900	2,253,096.00	0.38
27	603725	天安新材	322,700	2,229,857.00	0.38
28	600035	楚天高速	602,600	2,042,814.00	0.35
29	603093	南华期货	211,200	1,924,032.00	0.33
30	603398	沐邦高科	66,800	1,881,088.00	0.32
31	600754	锦江酒店	32,100	1,873,035.00	0.32
32	601198	东兴证券	241,900	1,867,468.00	0.32
33	600036	招商银行	49,600	1,848,096.00	0.31
34	603056	德邦股份	88,200	1,837,206.00	0.31
35	300910	瑞丰新材	14,700	1,812,657.00	0.31
36	300637	扬帆新材	259,300	1,669,892.00	0.28
37	600918	中泰证券	260,100	1,667,241.00	0.28
38	601600	中国铝业	370,300	1,655,241.00	0.28
39	300274	阳光电源	14,800	1,654,640.00	0.28
40	601168	西部矿业	161,800	1,650,360.00	0.28
41	300761	立华股份	47,500	1,626,875.00	0.28
42	600031	三一重工	100,900	1,594,220.00	0.27
43	000860	顺鑫农业	53,400	1,592,388.00	0.27
44	000719	中原传媒	194,600	1,562,638.00	0.27
45	002865	钧达股份	8,400	1,554,840.00	0.26
46	300281	金明精机	312,600	1,531,740.00	0.26
47	300707	威唐工业	98,100	1,514,664.00	0.26
48	002830	名雕股份	127,000	1,468,120.00	0.25
49	600958	东方证券	161,900	1,447,386.00	0.25
50	600276	恒瑞医药	37,400	1,441,022.00	0.25
51	002154	报喜鸟	338,200	1,393,384.00	0.24
52	002372	伟星新材	63,700	1,359,358.00	0.23
53	603501	韦尔股份	17,600	1,356,784.00	0.23
54	600073	上海梅林	168,600	1,340,370.00	0.23
55	000959	首钢股份	349,400	1,317,238.00	0.22
56	600535	天士力	121,500	1,307,340.00	0.22
57	000553	安道麦 A	144,300	1,305,915.00	0.22
58	600702	舍得酒业	8,000	1,273,440.00	0.22
59	600559	老白干酒	45,000	1,238,850.00	0.21
60	605117	德业股份	3,700	1,225,440.00	0.21
61	600009	上海机场	21,100	1,217,681.00	0.21



62	603488	展鹏科技	185,000	1,213,600.00	0.21
63	600757	长江传媒	212,200	1,209,540.00	0.21
64	002996	顺博合金	92,600	1,206,578.00	0.21
65	002661	克明食品	101,200	1,192,136.00	0.20
66	600600	青岛啤酒	11,000	1,182,500.00	0.20
67	002567	唐人神	166,000	1,175,280.00	0.20
68	600961	株冶集团	165,300	1,173,630.00	0.20
69	600901	江苏租赁	212,400	1,163,952.00	0.20
70	300326	凯利泰	160,800	1,157,760.00	0.20
71	603128	华贸物流	106,800	1,147,032.00	0.20
72	000417	合肥百货	208,500	1,136,325.00	0.19
73	603813	原尚股份	78,200	1,135,464.00	0.19
74	600115	中国东航	202,900	1,122,037.00	0.19
75	603886	元祖股份	56,700	1,112,454.00	0.19
76	300868	杰美特	72,700	1,110,129.00	0.19
77	600959	江苏有线	365,600	1,085,832.00	0.18
78	601021	春秋航空	16,800	1,079,400.00	0.18
79	600455	博通股份	48,600	1,075,032.00	0.18
80	300861	美畅股份	21,800	1,071,688.00	0.18
81	603803	瑞斯康达	178,000	1,071,560.00	0.18
82	000869	张裕 A	35,400	1,070,496.00	0.18
83	000890	法尔胜	274,400	1,056,440.00	0.18
84	600872	中炬高新	28,400	1,047,108.00	0.18
85	002961	瑞达期货	77,200	1,029,076.00	0.17
86	600128	弘业股份	129,000	1,003,620.00	0.17
87	600057	厦门象屿	97,500	1,001,325.00	0.17
88	603529	爱玛科技	21,500	986,205.00	0.17
89	603682	锦和商管	178,400	965,144.00	0.16
90	002807	江阴银行	242,900	964,313.00	0.16
91	002572	索菲亚	53,000	962,480.00	0.16
92	605499	东鹏饮料	5,400	960,660.00	0.16
93	603967	中创物流	95,400	952,092.00	0.16
94	603589	口子窖	16,500	951,555.00	0.16
95	000565	渝三峡 A	160,000	939,200.00	0.16
96	600126	杭钢股份	227,300	938,749.00	0.16
97	002199	东晶电子	146,000	932,940.00	0.16
98	600827	百联股份	75,700	917,484.00	0.16
99	002557	洽洽食品	18,300	915,000.00	0.16
100	600422	昆药集团	64,700	913,564.00	0.16
101	002670	国盛金控	123,100	912,171.00	0.16
102	601108	财通证券	127,200	905,664.00	0.15
103	600688	上海石化	290,500	903,455.00	0.15
104	600258	首旅酒店	36,400	902,720.00	0.15

105	000895	双汇发展	34,800	902,364.00	0.15
106	600425	青松建化	244,400	901,836.00	0.15
107	600998	九州通	68,500	893,240.00	0.15
108	601000	唐山港	325,800	892,692.00	0.15
109	600819	耀皮玻璃	190,800	881,496.00	0.15
110	000825	太钢不锈	203,500	879,120.00	0.15
111	600694	大商股份	47,500	859,750.00	0.15
112	600232	金鹰股份	154,400	843,024.00	0.14
113	300831	派瑞股份	63,800	833,866.00	0.14
114	603387	基蛋生物	66,700	833,750.00	0.14
115	600197	伊力特	33,900	831,906.00	0.14
116	600643	爱建集团	149,000	822,480.00	0.14
117	000156	华数传媒	109,200	817,908.00	0.14
118	600029	南方航空	107,200	814,720.00	0.14
119	603444	吉比特	2,600	813,384.00	0.14
120	300865	大宏立	45,500	811,265.00	0.14
121	002756	永兴材料	8,800	811,096.00	0.14
122	000821	京山轻机	48,800	800,320.00	0.14
123	002400	省广集团	185,300	793,084.00	0.13
124	603099	长白山	72,800	790,608.00	0.13
125	600854	春兰股份	173,200	786,328.00	0.13
126	600356	恒丰纸业	106,500	779,580.00	0.13
127	600059	古越龙山	80,000	776,800.00	0.13
128	300107	建新股份	149,500	768,430.00	0.13
129	600814	杭州解百	103,900	767,821.00	0.13
130	300194	福安药业	211,700	762,120.00	0.13
131	300155	安居宝	165,200	759,920.00	0.13
132	600436	片仔癀	2,600	749,996.00	0.13
133	301085	亚康股份	26,900	749,434.00	0.13
134	600857	宁波中百	67,500	748,575.00	0.13
135	603199	九华旅游	26,200	744,866.00	0.13
136	600741	华域汽车	42,900	743,457.00	0.13
137	002275	桂林三金	55,800	737,676.00	0.13
138	000776	广发证券	47,600	737,324.00	0.13
139	600467	好当家	261,400	724,078.00	0.12
140	300146	汤臣倍健	31,700	723,394.00	0.12
141	600626	申达股份	200,900	723,240.00	0.12
142	300828	锐新科技	52,615	721,351.65	0.12
143	300930	屹通新材	29,800	718,776.00	0.12
144	002774	快意电梯	111,100	711,040.00	0.12
145	603288	海天味业	8,900	708,440.00	0.12
146	002500	山西证券	133,500	707,550.00	0.12
147	603332	苏州龙杰	66,200	707,016.00	0.12

148	002345	潮宏基	134,200	705,892.00	0.12
149	600231	凌钢股份	327,400	703,910.00	0.12
150	002083	孚日股份	148,400	703,416.00	0.12
151	300387	富邦股份	107,900	699,192.00	0.12
152	600170	上海建工	268,900	699,140.00	0.12
153	603656	泰禾智能	61,700	699,061.00	0.12
154	600279	重庆港	176,000	698,720.00	0.12
155	601633	长城汽车	23,400	693,108.00	0.12
156	600054	黄山旅游	54,400	693,056.00	0.12
157	601996	丰林集团	256,500	692,550.00	0.12
158	000702	正虹科技	121,600	690,688.00	0.12
159	601801	皖新传媒	132,300	689,283.00	0.12
160	300433	蓝思科技	65,400	688,662.00	0.12
161	600710	苏美达	117,000	687,960.00	0.12
162	600017	日照港	242,700	684,414.00	0.12
163	603660	苏州科达	131,300	682,760.00	0.12
164	601339	百隆东方	118,500	675,450.00	0.11
165	300610	晨化股份	53,800	674,652.00	0.11
166	300059	东方财富	34,700	673,180.00	0.11
167	300279	和晶科技	136,200	672,828.00	0.11
168	002899	英派斯	53,700	672,324.00	0.11
169	000655	金岭矿业	100,900	667,958.00	0.11
170	601127	赛力斯	16,700	667,833.00	0.11
171	600724	宁波富达	182,800	667,220.00	0.11
172	300615	欣天科技	59,300	666,532.00	0.11
173	002092	中泰化学	89,200	665,432.00	0.11
174	600507	方大特钢	110,400	664,608.00	0.11
175	600598	北大荒	48,130	662,268.80	0.11
176	600369	西南证券	176,000	660,000.00	0.11
177	603883	老百姓	16,300	659,661.00	0.11
178	300689	澄天伟业	40,300	656,487.00	0.11
179	600735	新华锦	103,500	654,120.00	0.11
180	600368	五洲交通	173,700	653,112.00	0.11
181	002769	普路通	78,600	649,236.00	0.11
182	603113	金能科技	71,400	647,598.00	0.11
183	603329	上海雅仕	39,900	646,779.00	0.11
184	603868	飞科电器	9,500	639,635.00	0.11
185	300270	中威电子	120,100	635,329.00	0.11
186	000709	河钢股份	281,100	635,286.00	0.11
187	600703	三安光电	37,000	634,920.00	0.11
188	300720	海川智能	48,300	632,247.00	0.11
189	603958	哈森股份	97,800	630,810.00	0.11
190	600573	惠泉啤酒	57,200	627,484.00	0.11

191	600731	湖南海利	83,200	620,672.00	0.11
192	600597	光明乳业	57,400	617,624.00	0.11
193	300439	美康生物	52,400	613,080.00	0.10
194	603421	鼎信通讯	73,200	612,684.00	0.10
195	300399	天利科技	60,000	609,600.00	0.10
196	300701	森霸传感	77,300	608,351.00	0.10
197	002534	西子洁能	42,000	608,160.00	0.10
198	002705	新宝股份	36,200	602,730.00	0.10
199	000788	北大医药	81,000	602,640.00	0.10
200	300250	初灵信息	56,100	600,831.00	0.10
201	600697	欧亚集团	42,900	599,742.00	0.10
202	600787	中储股份	120,300	597,891.00	0.10
203	300826	测绘股份	53,000	596,250.00	0.10
204	601107	四川成渝	156,600	595,080.00	0.10
205	002461	珠江啤酒	74,100	593,541.00	0.10
206	300999	金龙鱼	13,600	592,416.00	0.10
207	300126	锐奇股份	106,000	591,480.00	0.10
208	300183	东软载波	48,900	589,245.00	0.10
209	002737	葵花药业	25,400	588,772.00	0.10
210	002743	富煌钢构	110,000	587,400.00	0.10
211	601117	中国化学	73,900	586,766.00	0.10
212	600008	首创环保	207,000	585,810.00	0.10
213	600188	兖矿能源	17,300	580,934.00	0.10
214	000898	鞍钢股份	217,100	579,657.00	0.10
215	601598	中国外运	149,400	573,696.00	0.10
216	600060	海信视像	42,100	570,034.00	0.10
217	600831	广电网络	96,700	568,596.00	0.10
218	300920	润阳科技	36,600	568,398.00	0.10
219	002810	山东赫达	25,300	567,226.00	0.10
220	002281	光迅科技	35,900	564,348.00	0.10
221	301053	远信工业	27,500	557,975.00	0.09
222	002603	以岭药业	18,600	557,256.00	0.09
223	000848	承德露露	65,700	557,136.00	0.09
224	300306	远方信息	59,900	555,872.00	0.09
225	001965	招商公路	71,200	553,224.00	0.09
226	601811	新华文轩	55,500	550,560.00	0.09
227	601019	山东出版	87,400	548,872.00	0.09
228	605177	东亚药业	27,400	548,548.00	0.09
229	600851	海欣股份	93,500	546,975.00	0.09
230	603790	雅运股份	54,600	546,546.00	0.09
231	300684	中石科技	36,800	545,008.00	0.09
232	600053	九鼎投资	36,800	543,904.00	0.09
233	600108	亚盛集团	171,900	539,766.00	0.09

234	603767	中马传动	75,200	538,432.00	0.09
235	601518	吉林高速	184,900	538,059.00	0.09
236	300641	正丹股份	105,800	537,464.00	0.09
237	600737	中粮糖业	77,200	535,768.00	0.09
238	301067	显盈科技	14,800	535,020.00	0.09
239	002472	双环传动	21,000	534,450.00	0.09
240	600716	凤凰股份	136,100	532,151.00	0.09
241	600295	鄂尔多斯	35,000	531,650.00	0.09
242	300311	任子行	87,400	531,392.00	0.09
243	603006	黎明股份	60,200	529,760.00	0.09
244	000099	中信海直	72,700	529,256.00	0.09
245	600308	华泰股份	104,100	527,787.00	0.09
246	000900	现代投资	126,100	527,098.00	0.09
247	002082	万邦德	59,700	526,554.00	0.09
248	000715	中兴商业	59,000	526,280.00	0.09
249	605058	澳弘电子	28,200	525,930.00	0.09
250	600037	歌华有线	64,600	525,844.00	0.09
251	600616	金枫酒业	75,200	523,392.00	0.09
252	002772	众兴菌业	62,900	523,328.00	0.09
253	603928	兴业股份	49,100	520,951.00	0.09
254	600287	江苏舜天	98,800	518,700.00	0.09
255	300245	天玑科技	68,000	516,120.00	0.09
256	603663	三祥新材	40,500	514,755.00	0.09
257	603776	永安行	40,700	512,006.00	0.09
258	600064	南京高科	77,200	510,292.00	0.09
259	601010	文峰股份	175,500	507,195.00	0.09
260	300264	佳创视讯	84,000	506,520.00	0.09
261	000507	珠海港	90,000	504,900.00	0.09
262	600137	浪莎股份	34,400	504,648.00	0.09
263	600979	广安爱众	152,700	503,910.00	0.09
264	002815	崇达技术	50,800	503,428.00	0.09
265	300597	吉大通信	67,100	503,250.00	0.09
266	002507	涪陵榨菜	19,500	502,515.00	0.09
267	301081	严牌股份	43,500	501,990.00	0.09
268	603001	奥康国际	78,000	501,540.00	0.09
269	002842	翔鹭钨业	64,200	500,760.00	0.09
270	003032	传智教育	29,000	500,540.00	0.09
271	600307	酒钢宏兴	303,300	500,445.00	0.09
272	600420	国药现代	54,500	495,950.00	0.08
273	600858	银座股份	76,300	493,661.00	0.08
274	000985	大庆华科	28,300	492,986.00	0.08
275	605567	春雪食品	31,700	489,131.00	0.08
276	600361	华联综超	80,700	489,042.00	0.08

277	603269	海鸥股份	39,500	487,825.00	0.08
278	002100	天康生物	58,700	487,797.00	0.08
279	600033	福建高速	168,100	487,490.00	0.08
280	600655	豫园股份	63,900	486,279.00	0.08
281	600439	瑞贝卡	180,600	485,814.00	0.08
282	603585	苏利股份	27,400	485,802.00	0.08
283	603214	爱婴室	26,700	482,736.00	0.08
284	600820	隧道股份	91,500	482,205.00	0.08
285	600622	光大嘉宝	147,200	481,344.00	0.08
286	600022	山东钢铁	325,100	481,148.00	0.08
287	300243	瑞丰高材	62,200	480,806.00	0.08
288	600708	光明地产	194,800	479,208.00	0.08
289	600867	通化东宝	52,200	479,196.00	0.08
290	603848	好太太	34,300	478,485.00	0.08
291	000885	城发环境	50,500	478,235.00	0.08
292	300990	同飞股份	5,200	477,776.00	0.08
293	002843	泰嘉股份	23,500	476,580.00	0.08
294	600012	皖通高速	64,700	472,957.00	0.08
295	603365	水星家纺	36,000	472,320.00	0.08
296	601860	紫金银行	181,200	469,308.00	0.08
297	000048	京基智农	26,256	468,669.60	0.08
298	600007	中国国贸	29,600	468,568.00	0.08
299	603196	日播时尚	62,100	468,234.00	0.08
300	301056	森赫股份	61,400	467,254.00	0.08
301	000830	鲁西化工	37,400	463,386.00	0.08
302	600612	老凤祥	10,800	462,240.00	0.08
303	300333	兆日科技	79,300	461,526.00	0.08
304	600449	宁夏建材	38,800	460,556.00	0.08
305	600386	北巴传媒	115,800	459,726.00	0.08
306	600020	中原高速	155,100	459,096.00	0.08
307	603507	振江股份	15,400	459,074.00	0.08
308	000926	福星股份	107,800	458,150.00	0.08
309	300668	杰恩设计	23,100	454,608.00	0.08
310	603903	中持股份	50,200	453,808.00	0.08
311	002373	千方科技	50,700	452,244.00	0.08
312	603328	依顿电子	69,500	451,055.00	0.08
313	600398	海澜之家	84,900	449,970.00	0.08
314	002632	道明光学	70,400	449,152.00	0.08
315	300403	汉宇集团	76,100	448,990.00	0.08
316	600704	物产中大	92,700	445,887.00	0.08
317	300642	透景生命	21,400	444,906.00	0.08
318	600717	天津港	108,500	444,850.00	0.08
319	605028	世茂能源	26,300	441,051.00	0.07

320	603716	塞力医疗	39,900	440,496.00	0.07
321	002493	荣盛石化	35,700	439,110.00	0.07
322	002460	赣锋锂业	6,300	437,913.00	0.07
323	300242	佳云科技	128,700	437,580.00	0.07
324	300606	金太阳	37,200	436,728.00	0.07
325	000906	浙商中拓	48,400	436,084.00	0.07
326	002650	加加食品	93,500	431,970.00	0.07
327	603898	好莱客	38,100	431,292.00	0.07
328	603010	万盛股份	36,300	429,429.00	0.07
329	301072	中捷精工	20,900	428,450.00	0.07
330	600936	广西广电	118,200	427,884.00	0.07
331	300705	九典制药	17,500	425,250.00	0.07
332	600180	瑞茂通	75,100	425,066.00	0.07
333	600409	三友化工	64,200	424,362.00	0.07
334	600637	东方明珠	63,700	423,605.00	0.07
335	600782	新钢股份	103,300	422,497.00	0.07
336	002802	洪汇新材	29,200	422,232.00	0.07
337	002106	莱宝高科	54,900	421,632.00	0.07
338	000061	农产品	73,900	421,230.00	0.07
339	603648	畅联股份	46,400	419,920.00	0.07
340	002988	豪美新材	31,400	419,190.00	0.07
341	003021	兆威机电	8,700	418,209.00	0.07
342	603708	家家悦	33,200	417,988.00	0.07
343	000998	隆平高科	26,000	417,820.00	0.07
344	600548	深高速	46,400	416,672.00	0.07
345	603719	良品铺子	11,300	416,631.00	0.07
346	600269	赣粤高速	122,800	416,292.00	0.07
347	002787	华源控股	68,900	415,467.00	0.07
348	600210	紫江企业	82,800	414,000.00	0.07
349	002889	东方嘉盛	18,300	413,946.00	0.07
350	300272	开能健康	79,400	413,674.00	0.07
351	603516	淳中科技	31,500	412,650.00	0.07
352	601577	长沙银行	60,600	409,656.00	0.07
353	600569	安阳钢铁	197,800	409,446.00	0.07
354	300899	上海凯鑫	20,700	408,825.00	0.07
355	000955	欣龙控股	81,900	408,681.00	0.07
356	600080	金花股份	52,300	408,463.00	0.07
357	300691	联合光电	32,800	407,704.00	0.07
358	002146	荣盛发展	187,600	407,092.00	0.07
359	600428	中远海特	68,300	407,068.00	0.07
360	603920	世运电路	28,300	406,954.00	0.07
361	600793	宜宾纸业	30,800	406,252.00	0.07
362	603159	上海亚虹	31,140	406,065.60	0.07

363	601828	美凯龙	86,300	404,747.00	0.07
364	601607	上海医药	22,700	404,741.00	0.07
365	300802	矩子科技	22,000	404,360.00	0.07
366	000426	兴业矿业	66,200	403,158.00	0.07
367	002144	宏达高科	39,900	402,990.00	0.07
368	600172	黄河旋风	83,100	402,204.00	0.07
369	601882	海天精工	15,300	400,860.00	0.07
370	603226	菲林格尔	80,900	398,837.00	0.07
371	600715	文投控股	164,800	398,816.00	0.07
372	002230	科大讯飞	12,100	397,243.00	0.07
373	002521	齐峰新材	78,600	396,930.00	0.07
374	601929	吉视传媒	204,400	396,536.00	0.07
375	600939	重庆建工	113,400	395,766.00	0.07
376	601098	中南传媒	39,500	394,210.00	0.07
377	603630	拉芳家化	25,100	393,819.00	0.07
378	603551	奥普家居	40,000	390,000.00	0.07
379	300371	汇中股份	34,600	389,250.00	0.07
380	002913	奥士康	15,900	387,483.00	0.07
381	300519	新光药业	24,700	386,802.00	0.07
382	605098	行动教育	13,200	386,496.00	0.07
383	002099	海翔药业	54,900	384,849.00	0.07
384	603607	京华激光	29,700	382,833.00	0.07
385	600883	博闻科技	52,800	381,744.00	0.06
386	002377	国创高新	140,100	381,072.00	0.06
387	002826	易明医药	37,200	379,068.00	0.06
388	000030	富奥股份	86,000	378,400.00	0.06
389	600141	兴发集团	13,000	377,000.00	0.06
390	600808	马钢股份	134,100	376,821.00	0.06
391	600246	万通发展	59,900	376,771.00	0.06
392	603797	联泰环保	67,600	373,152.00	0.06
393	002001	新和成	19,900	373,125.00	0.06
394	600292	远达环保	66,600	372,960.00	0.06
395	603598	引力传媒	39,800	369,344.00	0.06
396	600125	铁龙物流	67,500	368,550.00	0.06
397	300682	朗新科技	16,700	367,066.00	0.06
398	600229	城市传媒	51,900	366,933.00	0.06
399	600133	东湖高新	66,400	365,200.00	0.06
400	603368	柳药集团	19,400	362,198.00	0.06
401	600834	申通地铁	44,000	359,920.00	0.06
402	600785	新华百货	19,300	357,822.00	0.06
403	002712	思美传媒	71,800	357,564.00	0.06
404	600908	无锡银行	67,800	357,306.00	0.06
405	300275	梅安森	30,200	356,662.00	0.06



406	002734	利民股份	38,000	355,680.00	0.06
407	002946	新乳业	26,800	354,564.00	0.06
408	002659	凯文教育	77,900	354,445.00	0.06
409	603613	国联股份	4,000	353,760.00	0.06
410	600843	上工申贝	71,200	353,152.00	0.06
411	300612	宣亚国际	19,000	350,170.00	0.06
412	000501	武商集团	31,200	349,440.00	0.06
413	300468	四方精创	34,900	349,000.00	0.06
414	300058	蓝色光标	69,000	348,450.00	0.06
415	000089	深圳机场	44,300	348,198.00	0.06
416	601825	沪农商行	59,000	346,920.00	0.06
417	300739	明阳电路	26,900	346,472.00	0.06
418	600630	龙头股份	63,300	346,251.00	0.06
419	300042	朗科科技	28,500	345,990.00	0.06
420	605060	联德股份	13,400	345,854.00	0.06
421	600530	交大昂立	91,000	345,800.00	0.06
422	600990	四创电子	11,600	345,680.00	0.06
423	000799	酒鬼酒	2,500	344,850.00	0.06
424	002862	实丰文化	23,500	344,745.00	0.06
425	601665	齐鲁银行	82,500	344,025.00	0.06
426	002891	中宠股份	15,400	343,574.00	0.06
427	002986	宇新股份	15,800	343,492.00	0.06
428	300074	华平股份	91,400	342,750.00	0.06
429	002381	双箭股份	53,200	339,416.00	0.06
430	000961	中南建设	154,900	339,231.00	0.06
431	600551	时代出版	33,300	338,994.00	0.06
432	300621	维业股份	42,800	338,976.00	0.06
433	002437	誉衡药业	133,200	338,328.00	0.06
434	603818	曲美家居	53,700	338,310.00	0.06
435	300096	易联众	56,300	337,800.00	0.06
436	300016	北陆药业	51,800	337,736.00	0.06
437	003020	立方制药	10,400	335,920.00	0.06
438	600798	宁波海运	90,300	335,916.00	0.06
439	002957	科瑞技术	22,200	335,886.00	0.06
440	002637	赞宇科技	27,300	335,244.00	0.06
441	000791	甘肃电投	63,300	334,224.00	0.06
442	603156	养元饮品	15,000	334,050.00	0.06
443	300515	三德科技	27,500	333,575.00	0.06
444	600176	中国巨石	24,300	333,153.00	0.06
445	603268	松发股份	24,900	332,166.00	0.06
446	603136	天目湖	12,200	331,230.00	0.06
447	002048	宁波华翔	23,800	330,820.00	0.06
448	300820	英杰电气	4,500	330,660.00	0.06

449	300335	迪森股份	72,400	330,144.00	0.06
450	600711	盛屯矿业	55,700	328,073.00	0.06
451	603316	诚邦股份	57,400	327,180.00	0.06
452	300800	力合科技	28,100	327,084.00	0.06
453	600278	东方创业	47,600	326,536.00	0.06
454	300727	润禾材料	13,400	325,888.00	0.06
455	002679	福建金森	31,000	325,190.00	0.06
456	600725	云维股份	102,700	324,532.00	0.06
457	603980	吉华集团	69,700	324,105.00	0.06
458	300296	利亚德	56,800	321,488.00	0.05
459	002468	申通快递	30,800	318,164.00	0.05
460	600019	宝钢股份	56,600	316,394.00	0.05
461	002824	和胜股份	10,700	315,864.00	0.05
462	000589	贵州轮胎	64,800	310,392.00	0.05
463	600262	北方股份	19,400	309,818.00	0.05
464	002956	西麦食品	20,600	306,322.00	0.05
465	603096	新经典	15,400	306,152.00	0.05
466	000050	深天马 A	35,300	305,698.00	0.05
467	300389	艾比森	35,000	305,550.00	0.05
468	600989	宝丰能源	25,300	305,371.00	0.05
469	603608	天创时尚	69,600	304,848.00	0.05
470	002492	恒基达鑫	49,000	304,780.00	0.05
471	600629	华建集团	69,200	303,788.00	0.05
472	000028	国药一致	9,200	302,588.00	0.05
473	603195	公牛集团	2,100	300,846.00	0.05
474	603730	岱美股份	18,700	300,696.00	0.05
475	002303	美盈森	84,700	299,838.00	0.05
476	300322	硕贝德	41,600	299,104.00	0.05
477	300230	永利股份	79,000	298,620.00	0.05
478	600585	海螺水泥	10,900	298,442.00	0.05
479	300886	华业香料	13,600	296,344.00	0.05
480	000905	厦门港务	40,800	294,576.00	0.05
481	000850	华茂股份	84,500	292,370.00	0.05
482	300856	科思股份	5,600	292,040.00	0.05
483	300357	我武生物	5,300	292,030.00	0.05
484	605020	永和股份	7,400	290,672.00	0.05
485	000910	大亚圣象	34,100	290,532.00	0.05
486	003016	欣贺股份	31,600	290,088.00	0.05
487	601336	新华保险	9,600	288,768.00	0.05
488	300291	百纳千成	60,200	287,756.00	0.05
489	300908	仲景食品	7,500	287,625.00	0.05
490	300938	信测标准	8,600	287,584.00	0.05
491	002887	绿茵生态	33,900	287,472.00	0.05

492	002216	三全食品	15,500	286,905.00	0.05
493	300771	智莱科技	21,500	286,810.00	0.05
494	600628	新世界	37,400	285,736.00	0.05
495	301006	迈拓股份	18,300	285,663.00	0.05
496	600833	第一医药	25,200	284,256.00	0.05
497	601933	永辉超市	77,700	283,605.00	0.05
498	300896	爱美客	500	283,175.00	0.05
499	600801	华新水泥	19,100	283,062.00	0.05
500	601333	广深铁路	124,000	281,480.00	0.05
501	002343	慈文传媒	43,200	281,232.00	0.05
502	002713	东易日盛	44,500	280,350.00	0.05
503	603103	横店影视	19,000	280,060.00	0.05
504	000989	九芝堂	31,700	279,277.00	0.05
505	300888	稳健医疗	3,900	278,850.00	0.05
506	603948	建业股份	12,800	278,656.00	0.05
507	000566	海南海药	65,200	278,404.00	0.05
508	300556	丝路视觉	15,800	277,606.00	0.05
509	603167	渤海轮渡	37,700	277,472.00	0.05
510	301004	嘉益股份	9,315	277,400.70	0.05
511	603866	桃李面包	18,000	277,200.00	0.05
512	603657	春光科技	17,400	277,008.00	0.05
513	600305	恒顺醋业	22,500	276,975.00	0.05
514	603385	惠达卫浴	39,900	276,906.00	0.05
515	605378	野马电池	13,000	276,640.00	0.05
516	601566	九牧王	36,200	276,206.00	0.05
517	000913	钱江摩托	14,900	275,352.00	0.05
518	603535	嘉诚国际	15,400	275,198.00	0.05
519	002718	友邦吊顶	20,300	275,065.00	0.05
520	000582	北部湾港	37,200	274,908.00	0.05
521	300787	海能实业	10,100	274,417.00	0.05
522	603518	锦泓集团	40,900	274,030.00	0.05
523	600755	厦门国贸	38,300	273,462.00	0.05
524	600859	王府井	9,700	272,958.00	0.05
525	603909	建发合诚	25,500	272,850.00	0.05
526	002344	海宁皮城	58,100	272,489.00	0.05
527	600778	友好集团	39,500	271,760.00	0.05
528	605158	华达新材	42,400	271,360.00	0.05
529	600350	山东高速	47,600	270,844.00	0.05
530	000718	苏宁环球	81,900	270,270.00	0.05
531	300843	胜蓝股份	15,300	268,515.00	0.05
532	000861	海印股份	119,300	268,425.00	0.05
533	002038	双鹭药业	32,600	267,972.00	0.05
534	600651	飞乐音响	82,900	267,767.00	0.05

535	002292	奥飞娱乐	57,400	267,484.00	0.05
536	601366	利群股份	42,700	267,302.00	0.05
537	300472	新元科技	25,200	267,120.00	0.05
538	601156	东航物流	17,500	267,050.00	0.05
539	002360	同德化工	37,900	266,437.00	0.05
540	603353	和顺石油	14,300	265,694.00	0.05
541	002075	沙钢股份	67,600	265,668.00	0.05
542	603505	金石资源	6,700	265,454.00	0.05
543	600611	大众交通	87,800	265,156.00	0.05
544	603165	荣晟环保	24,300	264,870.00	0.05
545	300115	长盈精密	25,600	264,448.00	0.04
546	603020	爱普股份	26,700	264,330.00	0.04
547	603717	天域生态	38,400	264,192.00	0.04
548	600792	云煤能源	75,900	263,373.00	0.04
549	605138	盛泰集团	24,400	262,544.00	0.04
550	000560	我爱我家	105,000	262,500.00	0.04
551	002278	神开股份	50,100	262,023.00	0.04
552	002902	铭普光磁	20,800	261,456.00	0.04
553	300972	万辰生物	21,700	261,268.00	0.04
554	000876	新希望	20,200	260,782.00	0.04
555	600567	山鹰国际	105,000	260,400.00	0.04
556	600987	航民股份	35,900	260,275.00	0.04
557	603788	宁波高发	24,400	260,104.00	0.04
558	002311	海大集团	4,200	259,266.00	0.04
559	603828	柯利达	79,900	258,077.00	0.04
560	601689	拓普集团	4,400	257,752.00	0.04
561	002818	富森美	21,000	255,990.00	0.04
562	600980	北矿科技	18,300	254,919.00	0.04
563	600156	华升股份	53,600	254,064.00	0.04
564	603233	大参林	6,400	253,440.00	0.04
565	605118	力鼎光电	20,200	252,500.00	0.04
566	601011	宝泰隆	72,700	252,269.00	0.04
567	600575	淮河能源	104,400	251,604.00	0.04
568	300405	科隆股份	47,000	251,450.00	0.04
569	301042	安联锐视	7,800	250,458.00	0.04
570	603861	白云电器	33,500	250,245.00	0.04
571	000656	金科股份	130,900	250,019.00	0.04
572	601618	中国中冶	78,600	249,948.00	0.04
573	601919	中远海控	24,200	249,018.00	0.04
574	000536	华映科技	131,600	247,408.00	0.04
575	600658	电子城	63,200	246,480.00	0.04
576	002134	天津普林	30,300	246,036.00	0.04
577	600835	上海机电	21,900	245,718.00	0.04

578	600479	千金药业	25,500	244,800.00	0.04
579	600825	新华传媒	61,600	244,552.00	0.04
580	603700	宁水集团	18,300	240,645.00	0.04
581	600189	泉阳泉	35,400	240,012.00	0.04
582	601928	凤凰传媒	30,200	239,184.00	0.04
583	605066	天正电气	31,700	236,482.00	0.04
584	000778	新兴铸管	64,300	234,695.00	0.04
585	603565	中谷物流	16,100	234,094.00	0.04
586	300889	爱克股份	17,800	227,840.00	0.04
587	002811	郑中设计	31,500	227,430.00	0.04
588	003011	海象新材	10,600	226,522.00	0.04
589	600315	上海家化	7,000	222,950.00	0.04
590	002228	合兴包装	69,300	222,453.00	0.04
591	000877	天山股份	26,000	221,520.00	0.04
592	300314	戴维医疗	17,000	220,660.00	0.04
593	601500	通用股份	59,200	219,040.00	0.04
594	605599	菜百股份	21,400	217,852.00	0.04
595	605266	健之佳	2,700	216,189.00	0.04
596	603536	惠发食品	27,000	215,460.00	0.04
597	300770	新媒股份	5,700	214,662.00	0.04
598	603922	金鸿顺	10,100	213,918.00	0.04
599	601595	上海电影	19,500	213,915.00	0.04
600	300388	节能国祯	34,600	213,828.00	0.04
601	603711	香飘飘	14,200	213,568.00	0.04
602	600250	南纺股份	36,600	213,378.00	0.04
603	002773	康弘药业	13,500	211,815.00	0.04
604	300549	优德精密	17,300	211,752.00	0.04
605	002831	裕同科技	6,400	211,648.00	0.04
606	300961	深水海纳	20,500	209,920.00	0.04
607	300238	冠昊生物	20,400	209,712.00	0.04
608	002091	江苏国泰	24,600	209,100.00	0.04
609	300003	乐普医疗	9,100	209,027.00	0.04
610	002365	永安药业	19,900	208,950.00	0.04
611	300921	南凌科技	11,900	208,607.00	0.04
612	002127	南极电商	43,300	208,273.00	0.04
613	300608	思特奇	25,500	208,080.00	0.04
614	000785	居然之家	50,800	207,772.00	0.04
615	300840	酷特智能	23,200	207,176.00	0.04
616	603198	迎驾贡酒	3,300	207,174.00	0.04
617	600282	南钢股份	65,700	206,955.00	0.04
618	600098	广州发展	37,200	206,460.00	0.04
619	603013	亚普股份	14,400	206,352.00	0.04
620	300854	中兰环保	13,500	206,280.00	0.04

621	300789	唐源电气	11,800	206,146.00	0.04
622	002242	九阳股份	12,500	206,000.00	0.04
623	603399	吉翔股份	14,900	205,620.00	0.03
624	002616	长青集团	42,900	205,491.00	0.03
625	603506	南都物业	16,600	205,342.00	0.03
626	600337	美克家居	72,800	205,296.00	0.03
627	300070	碧水源	43,400	205,282.00	0.03
628	601568	北元集团	36,200	205,254.00	0.03
629	300749	顶固集创	28,800	205,056.00	0.03
630	002775	文科园林	50,100	204,909.00	0.03
631	300376	易事特	30,000	204,900.00	0.03
632	300915	海融科技	4,900	204,820.00	0.03
633	002459	晶澳科技	3,400	204,306.00	0.03
634	600623	华谊集团	32,300	204,136.00	0.03
635	600173	卧龙地产	39,400	204,092.00	0.03
636	300240	飞力达	27,300	203,931.00	0.03
637	300901	中胤时尚	22,200	203,574.00	0.03
638	603313	梦百合	19,200	203,520.00	0.03
639	300864	南大环境	11,000	203,500.00	0.03
640	600743	华远地产	107,600	203,364.00	0.03
641	002032	苏泊尔	4,100	202,786.00	0.03
642	603011	合锻智能	24,800	202,616.00	0.03
643	300850	新强联	3,800	202,464.00	0.03
644	603321	梅轮电梯	29,500	202,370.00	0.03
645	300616	尚品宅配	10,300	202,292.00	0.03
646	002012	凯恩股份	38,600	202,264.00	0.03
647	002563	森马服饰	38,600	202,264.00	0.03
648	300776	帝尔激光	1,600	201,600.00	0.03
649	603221	爱丽家居	25,000	201,500.00	0.03
650	603836	海程邦达	12,600	201,096.00	0.03
651	300640	德艺文创	35,900	201,040.00	0.03
652	300148	天舟文化	54,900	200,934.00	0.03
653	300221	银禧科技	41,800	200,640.00	0.03
654	600076	康欣新材	68,700	200,604.00	0.03
655	002064	华峰化学	29,400	199,920.00	0.03
656	002110	三钢闽光	42,400	199,280.00	0.03
657	301130	西点药业	6,900	199,203.00	0.03
658	000828	东莞控股	22,200	199,134.00	0.03
659	603877	太平鸟	10,800	198,612.00	0.03
660	002977	天箭科技	5,400	198,180.00	0.03
661	601228	广州港	62,900	198,135.00	0.03
662	603709	中源家居	12,900	197,757.00	0.03
663	603959	百利科技	18,700	197,659.00	0.03

664	300577	开润股份	12,400	197,656.00	0.03
665	301057	汇隆新材	9,800	197,274.00	0.03
666	300033	同花顺	2,000	197,220.00	0.03
667	300184	力源信息	45,400	195,220.00	0.03
668	300813	泰林生物	4,200	195,132.00	0.03
669	300349	金卡智能	20,800	194,896.00	0.03
670	002967	广电计量	11,600	194,648.00	0.03
671	300819	聚杰微纤	13,400	194,568.00	0.03
672	600410	华胜天成	39,700	194,133.00	0.03
673	300970	华绿生物	10,900	194,020.00	0.03
674	600689	上海三毛	21,300	193,404.00	0.03
675	603326	我乐家居	24,200	193,116.00	0.03
676	002080	中材科技	9,000	192,870.00	0.03
677	300618	寒锐钴业	4,800	192,240.00	0.03
678	000685	中山公用	27,300	191,919.00	0.03
679	300462	华铭智能	22,900	190,986.00	0.03
680	601233	桐昆股份	13,200	190,740.00	0.03
681	601111	中国国航	17,900	189,740.00	0.03
682	603256	宏和科技	29,100	189,732.00	0.03
683	000401	冀东水泥	22,900	188,467.00	0.03
684	300635	中达安	14,900	188,336.00	0.03
685	000517	荣安地产	63,700	187,915.00	0.03
686	002936	郑州银行	79,700	187,295.00	0.03
687	601326	秦港股份	68,100	187,275.00	0.03
688	300355	蒙草生态	61,200	187,272.00	0.03
689	605318	法狮龙	13,600	187,000.00	0.03
690	000710	贝瑞基因	16,300	185,983.00	0.03
691	300200	高盟新材	26,600	185,934.00	0.03
692	002631	德尔未来	33,200	185,920.00	0.03
693	300931	通用电梯	28,200	185,838.00	0.03
694	002949	华阳国际	14,000	183,960.00	0.03
695	300810	中科海讯	10,600	183,592.00	0.03
696	600196	复星医药	5,200	183,248.00	0.03
697	600807	济南高新	53,400	181,560.00	0.03
698	002663	普邦股份	94,500	181,440.00	0.03
699	000973	佛塑科技	41,000	180,810.00	0.03
700	300414	中光防雷	24,700	180,557.00	0.03
701	300235	方直科技	17,300	179,574.00	0.03
702	600983	惠而浦	25,900	179,228.00	0.03
703	300958	建工修复	10,400	177,008.00	0.03
704	300815	玉禾田	11,600	176,668.00	0.03
705	300922	天秦装备	12,800	175,616.00	0.03
706	601187	厦门银行	30,500	174,765.00	0.03

707	600233	圆通速递	8,600	172,774.00	0.03
708	301119	正强股份	6,500	171,340.00	0.03
709	600802	福建水泥	31,300	167,455.00	0.03
710	000088	盐田港	32,800	166,296.00	0.03
711	300385	雪浪环境	28,000	164,920.00	0.03
712	002970	锐明技术	8,500	164,135.00	0.03
713	603386	骏亚科技	15,800	161,634.00	0.03
714	002672	东江环保	28,400	160,460.00	0.03
715	600894	广日股份	24,600	158,670.00	0.03
716	603983	丸美股份	4,700	158,578.00	0.03
717	300298	三诺生物	4,700	158,531.00	0.03
718	000020	深华发 A	17,700	158,061.00	0.03
719	300897	山科智能	5,900	155,583.00	0.03
720	300829	金丹科技	7,100	154,851.00	0.03
721	601921	浙版传媒	20,900	154,660.00	0.03
722	000739	普洛药业	7,100	152,934.00	0.03
723	600423	柳化股份	44,300	151,949.00	0.03
724	000532	华金资本	13,800	148,626.00	0.03
725	300979	华利集团	2,600	148,486.00	0.03
726	300583	赛托生物	6,500	148,135.00	0.03
727	301180	万祥科技	9,000	148,050.00	0.03
728	603369	今世缘	2,900	147,610.00	0.03
729	300150	世纪瑞尔	40,800	147,288.00	0.03
730	300949	奥雅股份	4,800	146,832.00	0.02
731	001296	长江材料	7,600	146,072.00	0.02
732	301066	万事利	13,000	145,990.00	0.02
733	300455	康拓红外	19,700	145,977.00	0.02
734	601298	青岛港	25,800	144,738.00	0.02
735	300102	乾照光电	22,900	144,728.00	0.02
736	000886	海南高速	29,800	144,530.00	0.02
737	002858	力盛体育	10,400	143,624.00	0.02
738	002795	永和智控	16,100	143,612.00	0.02
739	002293	罗莱生活	12,700	142,494.00	0.02
740	601599	浙文影业	43,700	142,462.00	0.02
741	300824	北鼎股份	16,000	142,400.00	0.02
742	301017	漱玉平民	7,900	142,121.00	0.02
743	603511	爱慕股份	9,100	142,051.00	0.02
744	603926	铁流股份	15,600	141,336.00	0.02
745	603060	国检集团	10,900	140,610.00	0.02
746	600097	开创国际	13,100	140,563.00	0.02
747	301001	凯淳股份	6,600	140,448.00	0.02
748	000793	华闻集团	54,600	140,322.00	0.02
749	603037	凯众股份	8,700	139,896.00	0.02



750	300541	先进数通	12,300	139,605.00	0.02
751	300876	蒙泰高新	4,539	139,483.47	0.02
752	300006	莱美药业	36,600	139,446.00	0.02
753	002691	冀凯股份	26,300	139,127.00	0.02
754	002697	红旗连锁	24,700	139,061.00	0.02
755	300079	数码视讯	29,000	138,910.00	0.02
756	300214	日科化学	21,200	138,860.00	0.02
757	600875	东方电气	6,600	138,732.00	0.02
758	300043	星辉娱乐	46,700	138,699.00	0.02
759	300652	雷迪克	6,700	138,690.00	0.02
760	002029	七匹狼	25,000	138,500.00	0.02
761	002615	哈尔斯	23,000	138,460.00	0.02
762	603026	胜华新材	1,500	138,450.00	0.02
763	605136	丽人丽妆	9,900	138,402.00	0.02
764	600448	华纺股份	43,600	138,212.00	0.02
765	603616	韩建河山	26,000	138,060.00	0.02
766	002976	瑞玛精密	6,100	138,043.00	0.02
767	300939	秋田微	5,100	137,904.00	0.02
768	603677	奇精机械	12,300	137,760.00	0.02
769	603259	药明康德	1,700	137,700.00	0.02
770	603893	瑞芯微	2,000	137,620.00	0.02
771	600400	红豆股份	33,400	137,608.00	0.02
772	603317	天味食品	5,000	137,400.00	0.02
773	300923	研奥股份	6,900	137,310.00	0.02
774	600165	新日恒力	20,300	137,228.00	0.02
775	002739	万达电影	9,800	137,200.00	0.02
776	300690	双一科技	8,500	137,190.00	0.02
777	002385	大北农	15,400	137,060.00	0.02
778	002035	华帝股份	24,700	136,838.00	0.02
779	600828	茂业商业	34,900	136,808.00	0.02
780	603079	圣达生物	10,900	136,795.00	0.02
781	300417	南华仪器	14,100	136,770.00	0.02
782	300350	华鹏飞	28,000	136,640.00	0.02
783	603960	克来机电	7,700	136,521.00	0.02
784	300484	蓝海华腾	13,000	136,500.00	0.02
785	603289	泰瑞机器	15,200	136,496.00	0.02
786	002375	亚厦股份	31,000	136,400.00	0.02
787	300943	春晖智控	11,300	136,391.00	0.02
788	605358	立昂微	3,200	136,320.00	0.02
789	603533	掌阅科技	9,400	136,206.00	0.02
790	300935	盈建科	5,300	136,104.00	0.02
791	300797	钢研纳克	9,000	136,080.00	0.02
792	603323	苏农银行	29,000	136,010.00	0.02

793	300582	英飞特	10,800	135,972.00	0.02
794	301036	双乐股份	8,200	135,956.00	0.02
795	301040	中环海陆	7,100	135,752.00	0.02
796	601162	天风证券	47,300	135,751.00	0.02
797	000672	上峰水泥	12,700	135,636.00	0.02
798	300952	恒辉安防	7,300	135,634.00	0.02
799	600249	两面针	25,800	135,450.00	0.02
800	601086	国芳集团	30,100	135,450.00	0.02
801	300419	浩丰科技	26,500	135,415.00	0.02
802	300187	永清环保	23,700	135,327.00	0.02
803	000931	中关村	22,000	135,300.00	0.02
804	002860	星帅尔	10,400	135,200.00	0.02
805	003008	开普检测	5,500	135,080.00	0.02
806	600889	南京化纤	27,100	134,958.00	0.02
807	601137	博威合金	9,100	134,771.00	0.02
808	300936	中英科技	5,400	134,568.00	0.02
809	300658	延江股份	14,700	134,505.00	0.02
810	600162	香江控股	71,800	134,266.00	0.02
811	300741	华宝股份	5,700	134,121.00	0.02
812	300426	唐德影视	19,400	134,054.00	0.02
813	300218	安利股份	13,400	134,000.00	0.02
814	002390	信邦制药	28,500	133,950.00	0.02
815	300651	金陵体育	6,000	133,860.00	0.02
816	600127	金健米业	17,400	133,806.00	0.02
817	301098	金埔园林	8,500	133,790.00	0.02
818	000023	深天地 A	9,700	133,569.00	0.02
819	603999	读者传媒	22,700	133,476.00	0.02
820	605500	森林包装	13,300	133,266.00	0.02
821	300599	雄塑科技	18,200	133,224.00	0.02
822	002767	先锋电子	11,800	133,104.00	0.02
823	002749	国光股份	15,000	133,050.00	0.02
824	600742	一汽富维	15,900	132,924.00	0.02
825	002655	共达电声	11,900	132,804.00	0.02
826	002626	金达威	6,400	132,608.00	0.02
827	603305	旭升集团	4,100	132,184.00	0.02
828	600789	鲁抗医药	18,200	132,132.00	0.02
829	603889	新澳股份	18,400	132,112.00	0.02
830	603808	歌力思	14,500	131,950.00	0.02
831	600705	中航产融	40,200	131,856.00	0.02
832	603569	长久物流	15,000	131,850.00	0.02
833	300220	金运激光	12,600	131,796.00	0.02
834	600285	羚锐制药	10,100	131,704.00	0.02
835	002600	领益智造	29,000	131,660.00	0.02

836	601916	浙商银行	44,600	131,124.00	0.02
837	000488	晨鸣纸业	26,300	130,974.00	0.02
838	603038	华立股份	18,300	130,845.00	0.02
839	600336	澳柯玛	23,900	130,733.00	0.02
840	600266	城建发展	28,100	130,665.00	0.02
841	002508	老板电器	4,700	130,472.00	0.02
842	300778	新城市	10,300	129,986.00	0.02
843	600810	神马股份	16,700	129,759.00	0.02
844	002906	华阳集团	3,900	129,558.00	0.02
845	603180	金牌厨柜	4,500	129,015.00	0.02
846	605336	帅丰电器	8,700	128,934.00	0.02
847	000902	新洋丰	11,200	128,912.00	0.02
848	301013	利和兴	14,600	128,626.00	0.02
849	601138	工业富联	14,000	128,520.00	0.02
850	300675	建科院	8,900	126,736.00	0.02
851	300502	新易盛	5,300	125,875.00	0.02
852	002403	爱仕达	16,200	125,550.00	0.02
853	002019	亿帆医药	10,200	124,950.00	0.02
854	300703	创源股份	12,600	124,614.00	0.02
855	600120	浙江东方	34,500	123,165.00	0.02
856	301065	本立科技	4,000	123,120.00	0.02
857	300564	筑博设计	10,600	123,066.00	0.02
858	300127	银河磁体	8,100	123,039.00	0.02
859	300528	幸福蓝海	14,600	122,786.00	0.02
860	600167	联美控股	19,400	122,608.00	0.02
861	000717	中南股份	42,700	121,695.00	0.02
862	301235	华康医疗	3,400	121,618.00	0.02
863	000623	吉林敖东	8,100	121,419.00	0.02
864	601236	红塔证券	16,400	121,360.00	0.02
865	301061	匠心家居	4,200	120,792.00	0.02
866	300011	鼎汉技术	21,800	118,592.00	0.02
867	002812	恩捷股份	900	118,161.00	0.02
868	300609	汇纳科技	7,600	117,648.00	0.02
869	600358	国旅联合	16,900	116,272.00	0.02
870	301028	东亚机械	13,000	116,090.00	0.02
871	600663	陆家嘴	11,800	114,932.00	0.02
872	300181	佐力药业	10,300	109,901.00	0.02
873	601686	友发集团	18,400	109,296.00	0.02
874	600895	张江高科	9,600	108,864.00	0.02
875	000823	超声电子	11,500	106,835.00	0.02
876	605389	长龄液压	4,100	105,411.00	0.02
877	601963	重庆银行	15,500	105,090.00	0.02
878	603615	茶花股份	13,100	104,014.00	0.02

879	603579	荣泰健康	5,200	103,948.00	0.02
880	300538	同益股份	10,000	103,900.00	0.02
881	002975	博杰股份	3,200	101,344.00	0.02
882	300164	通源石油	25,500	100,980.00	0.02
883	300867	圣元环保	5,900	100,477.00	0.02
884	000661	长春高新	600	99,870.00	0.02
885	002677	浙江美大	9,000	99,720.00	0.02
886	301068	大地海洋	3,900	95,784.00	0.02
887	002856	美芝股份	9,500	95,570.00	0.02
888	600280	中央商场	29,000	94,830.00	0.02
889	300947	德必集团	7,100	94,004.00	0.02
890	001206	依依股份	3,800	92,416.00	0.02
891	603609	禾丰股份	7,500	88,800.00	0.02
892	600084	中葡股份	12,100	88,088.00	0.01
893	002020	京新药业	7,200	87,696.00	0.01
894	000639	西王食品	18,500	87,135.00	0.01
895	600887	伊利股份	2,800	86,800.00	0.01
896	600897	厦门空港	5,100	85,425.00	0.01
897	300622	博士眼镜	4,100	84,665.00	0.01
898	002893	华通热力	10,000	84,500.00	0.01
899	603706	东方环宇	6,000	82,680.00	0.01
900	000918	嘉凯城	37,800	81,648.00	0.01
901	600604	市北高新	16,500	81,510.00	0.01
902	301208	中亦科技	1,600	81,488.00	0.01
903	600640	国脉文化	8,300	80,095.00	0.01
904	603101	汇嘉时代	12,300	77,736.00	0.01
905	605155	西大门	5,800	75,458.00	0.01
906	002044	美年健康	12,300	75,399.00	0.01
907	603856	东宏股份	6,400	74,176.00	0.01
908	600480	凌云股份	8,700	74,037.00	0.01
909	605398	新炬网络	2,600	72,930.00	0.01
910	000537	广宇发展	5,500	72,765.00	0.01
911	600928	西安银行	20,600	72,512.00	0.01
912	603755	日辰股份	1,800	72,486.00	0.01
913	605288	凯迪股份	1,900	72,257.00	0.01
914	600561	江西长运	12,100	72,116.00	0.01
915	301002	崧盛股份	3,200	72,000.00	0.01
916	301025	读客文化	7,100	71,923.00	0.01
917	002968	新大正	3,300	71,907.00	0.01
918	600327	大东方	14,700	71,883.00	0.01
919	600489	中金黄金	8,700	71,253.00	0.01
920	301052	果麦文化	3,200	71,232.00	0.01
921	600682	南京新百	7,800	71,214.00	0.01

922	000429	粤高速 A	9,100	71,162.00	0.01
923	300258	精锻科技	6,100	70,943.00	0.01
924	605080	浙江自然	1,500	70,800.00	0.01
925	301041	金百泽	3,700	70,781.00	0.01
926	300516	久之洋	2,900	70,586.00	0.01
927	600650	锦江在线	6,500	70,525.00	0.01
928	600739	辽宁成大	5,600	70,504.00	0.01
929	300491	通合科技	5,100	70,482.00	0.01
930	603879	永悦科技	11,600	70,412.00	0.01
931	300679	电连技术	1,900	70,300.00	0.01
932	601908	京运通	10,700	70,299.00	0.01
933	603160	汇顶科技	1,400	70,280.00	0.01
934	600201	生物股份	7,800	70,278.00	0.01
935	300987	川网传媒	4,700	70,218.00	0.01
936	601999	出版传媒	10,700	70,085.00	0.01
937	300295	三六五网	7,900	70,073.00	0.01
938	603666	亿嘉和	2,200	69,938.00	0.01
939	300473	德尔股份	4,700	69,889.00	0.01
940	301011	华立科技	2,500	69,775.00	0.01
941	600790	轻纺城	15,000	69,750.00	0.01
942	003000	劲仔食品	5,900	69,561.00	0.01
943	301049	超越科技	3,300	69,531.00	0.01
944	603906	龙蟠科技	3,000	69,450.00	0.01
945	002399	海普瑞	5,400	69,390.00	0.01
946	603800	道森股份	2,600	69,368.00	0.01
947	301088	戎美股份	4,000	69,320.00	0.01
948	300561	汇金科技	7,700	69,300.00	0.01
949	002852	道道全	5,000	69,200.00	0.01
950	300977	深圳瑞捷	3,700	69,190.00	0.01
951	605116	奥锐特	2,800	69,132.00	0.01
952	300285	国瓷材料	2,500	68,925.00	0.01
953	000026	飞亚达	6,600	68,904.00	0.01
954	300883	龙利得	11,600	68,904.00	0.01
955	600444	国机通用	5,400	68,850.00	0.01
956	600749	西藏旅游	5,300	68,847.00	0.01
957	605580	恒盛能源	5,700	68,799.00	0.01
958	300594	朗进科技	4,000	68,760.00	0.01
959	300153	科泰电源	10,200	68,748.00	0.01
960	002867	周大生	4,900	68,747.00	0.01
961	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
962	002053	云南能投	6,200	68,696.00	0.01
963	300022	吉峰科技	14,400	68,688.00	0.01
964	002678	珠江钢琴	11,500	68,655.00	0.01

965	300088	长信科技	11,500	68,655.00	0.01
966	600321	正源股份	37,900	68,599.00	0.01
967	603917	合力科技	2,900	68,585.00	0.01
968	600594	益佰制药	12,400	68,572.00	0.01
969	300942	易瑞生物	4,000	68,560.00	0.01
970	002753	永东股份	8,200	68,552.00	0.01
971	300688	创业黑马	4,100	68,552.00	0.01
972	002512	达华智能	19,800	68,508.00	0.01
973	603587	地素时尚	4,500	68,490.00	0.01
974	300228	富瑞特装	13,400	68,474.00	0.01
975	603408	建霖家居	6,300	68,418.00	0.01
976	603558	健盛集团	8,300	68,392.00	0.01
977	300543	朗科智能	8,200	68,388.00	0.01
978	601212	白银有色	26,300	68,380.00	0.01
979	300546	雄帝科技	3,200	68,352.00	0.01
980	605289	罗曼股份	3,200	68,352.00	0.01
981	000019	深粮控股	9,100	68,341.00	0.01
982	600664	哈药股份	22,700	68,327.00	0.01
983	002918	蒙娜丽莎	3,800	68,324.00	0.01
984	603040	新坐标	4,000	68,320.00	0.01
985	002955	鸿合科技	2,900	68,295.00	0.01
986	603188	亚邦股份	18,500	68,265.00	0.01
987	002196	方正电机	9,400	68,244.00	0.01
988	301215	中汽股份	13,200	68,244.00	0.01
989	300005	探路者	9,000	68,220.00	0.01
990	300978	东箭科技	6,100	68,076.00	0.01
991	300623	捷捷微电	3,300	68,046.00	0.01
992	002951	金时科技	7,600	68,020.00	0.01
993	600679	上海凤凰	7,900	68,019.00	0.01
994	300880	迦南智能	4,700	68,009.00	0.01
995	300736	百邦科技	4,300	67,983.00	0.01
996	600371	万向德农	4,800	67,968.00	0.01
997	300141	和顺电气	8,400	67,956.00	0.01
998	300729	乐歌股份	4,200	67,914.00	0.01
999	300873	海晨股份	2,500	67,875.00	0.01
1,000	603121	华培动力	10,500	67,830.00	0.01
1,001	603976	正川股份	3,300	67,815.00	0.01
1,002	000420	吉林化纤	15,300	67,779.00	0.01
1,003	600683	京投发展	14,700	67,767.00	0.01
1,004	603023	威帝股份	17,600	67,760.00	0.01
1,005	301128	强瑞技术	2,700	67,743.00	0.01
1,006	600822	上海物贸	8,200	67,732.00	0.01
1,007	300055	万邦达	8,400	67,704.00	0.01

1,008	001313	粤海饲料	7,200	67,680.00	0.01
1,009	301187	欧圣电气	4,000	67,680.00	0.01
1,010	600151	航天机电	8,300	67,645.00	0.01
1,011	603890	春秋电子	7,400	67,636.00	0.01
1,012	600066	宇通客车	9,000	67,590.00	0.01
1,013	300308	中际旭创	2,500	67,575.00	0.01
1,014	002755	奥赛康	8,500	67,490.00	0.01
1,015	000703	恒逸石化	9,600	67,488.00	0.01
1,016	603168	莎普爱思	7,400	67,488.00	0.01
1,017	301007	德迈仕	6,200	67,456.00	0.01
1,018	300378	鼎捷软件	4,400	67,452.00	0.01
1,019	300932	三友联众	4,700	67,445.00	0.01
1,020	002016	世荣兆业	10,800	67,392.00	0.01
1,021	300289	利德曼	11,700	67,392.00	0.01
1,022	301092	争光股份	2,500	67,350.00	0.01
1,023	300352	北信源	16,500	67,320.00	0.01
1,024	600131	国网信通	4,500	67,320.00	0.01
1,025	600527	江南高纤	32,500	67,275.00	0.01
1,026	002165	红宝丽	16,600	67,230.00	0.01
1,027	603637	镇海股份	8,800	67,144.00	0.01
1,028	002570	贝因美	12,400	67,084.00	0.01
1,029	300302	同有科技	9,800	67,032.00	0.01
1,030	600498	烽火通信	5,100	67,014.00	0.01
1,031	002797	第一创业	11,900	66,997.00	0.01
1,032	601200	上海环境	7,500	66,975.00	0.01
1,033	002404	嘉欣丝绸	10,500	66,885.00	0.01
1,034	002117	东港股份	8,800	66,880.00	0.01
1,035	605268	王力安防	7,600	66,880.00	0.01
1,036	003012	东鹏控股	8,500	66,810.00	0.01
1,037	300654	世纪天鸿	6,600	66,792.00	0.01
1,038	603388	元成股份	7,700	66,759.00	0.01
1,039	001336	楚环科技	2,700	66,717.00	0.01
1,040	600513	联环药业	7,100	66,669.00	0.01
1,041	000603	盛达资源	5,300	66,568.00	0.01
1,042	601956	东贝集团	11,300	66,557.00	0.01
1,043	300570	太辰光	4,600	66,516.00	0.01
1,044	002286	保龄宝	7,300	66,357.00	0.01
1,045	601528	瑞丰银行	10,500	66,255.00	0.01
1,046	603076	乐惠国际	1,800	66,240.00	0.01
1,047	300539	横河精密	6,600	66,198.00	0.01
1,048	600873	梅花生物	6,500	66,170.00	0.01
1,049	300846	首都在线	6,800	66,164.00	0.01
1,050	002687	乔治白	13,600	66,096.00	0.01

1,051	000526	学大教育	3,700	66,045.00	0.01
1,052	300068	南都电源	3,100	66,030.00	0.01
1,053	000967	盈峰环境	14,500	65,830.00	0.01
1,054	603786	科博达	1,000	65,830.00	0.01
1,055	000031	大悦城	17,500	65,800.00	0.01
1,056	002827	高争民爆	7,000	65,730.00	0.01
1,057	000608	阳光股份	19,500	65,715.00	0.01
1,058	000800	一汽解放	8,500	65,705.00	0.01
1,059	603679	华体科技	5,500	65,615.00	0.01
1,060	300190	维尔利	15,800	65,570.00	0.01
1,061	600638	新黄浦	11,600	65,540.00	0.01
1,062	600720	祁连山	6,600	65,538.00	0.01
1,063	002721	金一文化	20,100	65,526.00	0.01
1,064	001216	华瓷股份	4,800	65,520.00	0.01
1,065	300453	三鑫医疗	7,600	65,512.00	0.01
1,066	002548	金新农	10,900	65,509.00	0.01
1,067	300955	嘉亨家化	2,700	65,502.00	0.01
1,068	300340	科恒股份	6,300	65,394.00	0.01
1,069	300457	赢合科技	3,700	65,379.00	0.01
1,070	601177	杭齿前进	8,000	65,360.00	0.01
1,071	300940	南极光	3,500	65,345.00	0.01
1,072	000521	长虹美菱	15,500	65,255.00	0.01
1,073	600096	云天化	3,100	65,224.00	0.01
1,074	600148	长春一东	4,800	65,184.00	0.01
1,075	600061	国投资本	10,200	65,178.00	0.01
1,076	000897	津滨发展	27,700	65,095.00	0.01
1,077	603017	中衡设计	7,100	65,036.00	0.01
1,078	600267	海正药业	5,900	65,018.00	0.01
1,079	603515	欧普照明	4,200	65,016.00	0.01
1,080	002839	张家港行	14,100	65,001.00	0.01
1,081	300844	山水比德	2,900	64,931.00	0.01
1,082	600143	金发科技	6,700	64,923.00	0.01
1,083	301077	星华新材	3,000	64,680.00	0.01
1,084	600699	均胜电子	4,600	64,630.00	0.01
1,085	600584	长电科技	2,800	64,540.00	0.01
1,086	601515	东风股份	15,000	64,500.00	0.01
1,087	600186	莲花健康	23,800	64,498.00	0.01
1,088	300808	久量股份	5,000	64,400.00	0.01
1,089	600572	康恩贝	13,600	64,328.00	0.01
1,090	600159	大龙地产	21,300	64,326.00	0.01
1,091	300881	盛德鑫泰	2,000	64,180.00	0.01
1,092	600528	中铁工业	8,400	64,092.00	0.01
1,093	002532	天山铝业	8,300	64,076.00	0.01



1,094	300983	尤安设计	2,300	64,055.00	0.01
1,095	300225	金力泰	12,300	63,960.00	0.01
1,096	603041	美思德	5,700	63,954.00	0.01
1,097	603109	神驰机电	4,500	63,900.00	0.01
1,098	000581	威孚高科	3,600	63,828.00	0.01
1,099	603090	宏盛股份	2,300	63,802.00	0.01
1,100	000887	中鼎股份	4,400	63,668.00	0.01
1,101	002325	洪涛股份	32,600	63,570.00	0.01
1,102	000708	中信特钢	3,700	63,492.00	0.01
1,103	000590	启迪药业	7,100	63,474.00	0.01
1,104	600119	长江投资	9,400	63,356.00	0.01
1,105	300664	鹏鹞环保	12,300	63,345.00	0.01
1,106	301045	天禄科技	3,900	63,336.00	0.01
1,107	001872	招商港口	4,400	63,184.00	0.01
1,108	300448	浩云科技	13,500	63,180.00	0.01
1,109	600845	宝信软件	1,400	62,720.00	0.01
1,110	600085	同仁堂	1,400	62,552.00	0.01
1,111	002068	黑猫股份	5,200	62,244.00	0.01
1,112	300428	立中集团	2,500	61,875.00	0.01
1,113	300211	亿通科技	8,400	61,488.00	0.01
1,114	300136	信维通信	3,700	61,087.00	0.01
1,115	002429	兆驰股份	17,500	61,075.00	0.01
1,116	001211	双枪科技	2,700	60,480.00	0.01
1,117	603718	海利生物	6,130	60,196.60	0.01
1,118	300981	中红医疗	3,200	60,096.00	0.01
1,119	002236	大华股份	5,300	59,943.00	0.01
1,120	002855	捷荣技术	7,600	59,888.00	0.01
1,121	002673	西部证券	9,800	59,682.00	0.01
1,122	600758	辽宁能源	15,400	58,982.00	0.01
1,123	605081	太和水	3,700	58,941.00	0.01
1,124	300788	中信出版	2,900	58,725.00	0.01
1,125	603367	辰欣药业	4,600	57,960.00	0.01
1,126	601238	广汽集团	5,200	57,356.00	0.01
1,127	000421	南京公用	11,700	57,213.00	0.01
1,128	300463	迈克生物	3,300	57,090.00	0.01
1,129	300851	交大思诺	2,600	56,550.00	0.01
1,130	300589	江龙船艇	5,400	56,052.00	0.01
1,131	600362	江西铜业	3,200	55,776.00	0.01
1,132	600234	科新发展	8,000	55,760.00	0.01
1,133	300677	英科医疗	2,600	54,678.00	0.01
1,134	000090	天健集团	9,900	54,054.00	0.01
1,135	002857	三晖电气	3,800	54,036.00	0.01
1,136	002646	天佑德酒	3,500	53,550.00	0.01

1,137	600377	宁沪高速	6,500	53,430.00	0.01
1,138	300712	永福股份	1,200	53,244.00	0.01
1,139	300002	神州泰岳	12,200	52,948.00	0.01
1,140	600745	闻泰科技	1,000	52,580.00	0.01
1,141	603348	文灿股份	900	51,813.00	0.01
1,142	603356	华菱精工	3,700	49,580.00	0.01
1,143	603058	永吉股份	6,800	49,504.00	0.01
1,144	603978	深圳新星	2,600	48,178.00	0.01
1,145	605368	蓝天燃气	3,900	48,165.00	0.01
1,146	300713	英可瑞	3,800	48,108.00	0.01
1,147	600346	恒力石化	3,000	46,590.00	0.01
1,148	605003	众望布艺	2,600	46,202.00	0.01
1,149	002107	沃华医药	6,900	42,780.00	0.01
1,150	603768	常青股份	2,800	41,748.00	0.01
1,151	300946	恒而达	1,400	40,096.00	0.01
1,152	002932	明德生物	700	40,089.00	0.01
1,153	603697	有友食品	3,200	39,808.00	0.01
1,154	002287	奇正藏药	1,700	38,845.00	0.01
1,155	300030	阳普医疗	5,600	38,584.00	0.01
1,156	600370	三房巷	12,500	37,875.00	0.01
1,157	002978	安宁股份	1,100	36,696.00	0.01
1,158	000650	仁和药业	5,900	36,521.00	0.01
1,159	002237	恒邦股份	3,400	35,836.00	0.01
1,160	300906	日月明	1,700	35,241.00	0.01
1,161	600676	交运股份	8,800	34,056.00	0.01
1,162	000659	珠海中富	10,300	32,342.00	0.01
1,163	002590	万安科技	3,900	31,239.00	0.01
1,164	300469	信息发展	2,500	30,550.00	0.01
1,165	002295	精艺股份	4,600	30,360.00	0.01
1,166	605056	咸亨国际	2,400	29,304.00	0.00
1,167	002790	瑞尔特	3,400	29,002.00	0.00
1,168	605488	福莱新材	2,100	28,056.00	0.00
1,169	603016	新宏泰	1,400	26,544.00	0.00
1,170	603429	集友股份	2,300	25,024.00	0.00
1,171	003015	日久光电	2,800	24,052.00	0.00
1,172	603829	洛凯股份	2,000	21,060.00	0.00
1,173	301062	上海艾录	2,300	17,940.00	0.00
1,174	300830	金现代	2,300	17,848.00	0.00
1,175	603008	喜临门	600	17,130.00	0.00
1,176	000096	广聚能源	2,100	16,842.00	0.00
1,177	300885	海昌新材	1,900	16,283.00	0.00
1,178	603022	新通联	1,800	16,038.00	0.00
1,179	601512	中新集团	1,800	14,382.00	0.00

1,180	605086	龙高股份	700	13,454.00	0.00
1,181	000036	华联控股	2,500	10,125.00	0.00
1,182	605296	神农集团	400	10,012.00	0.00
1,183	601588	北辰实业	3,800	7,752.00	0.00
1,184	600830	香溢融通	700	4,410.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300337	银邦股份	6,406,029.00	1.09
2	600732	爱旭股份	6,035,883.00	1.03
3	601668	中国建筑	5,860,212.00	1.00
4	300011	鼎汉技术	5,564,054.00	0.95
5	600348	华阳股份	5,494,123.00	0.93
6	600050	中国联通	5,471,872.00	0.93
7	601888	中国中免	5,450,752.00	0.93
8	600809	山西汾酒	5,445,549.00	0.93
9	000776	广发证券	5,445,526.46	0.93
10	002475	立讯精密	5,360,152.00	0.91
11	300604	长川科技	4,955,157.11	0.84
12	300134	大富科技	4,804,221.00	0.82
13	000568	泸州老窖	4,676,315.00	0.80
14	300116	保力新	4,560,103.00	0.78
15	600160	巨化股份	4,533,480.00	0.77
16	300430	诚益通	4,524,938.00	0.77
17	600519	贵州茅台	4,491,610.00	0.76
18	300279	和晶科技	4,341,439.00	0.74
19	002865	钧达股份	4,311,803.00	0.73
20	300195	长荣股份	4,286,551.00	0.73

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

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300337	银邦股份	6,407,435.00	1.09
2	600348	华阳股份	5,628,596.00	0.96
3	300011	鼎汉技术	5,238,107.00	0.89
4	300134	大富科技	5,154,274.00	0.88
5	000777	中核科技	4,763,372.00	0.81
6	000776	广发证券	4,385,345.00	0.75
7	300430	诚益通	4,374,487.00	0.74

8	300116	保力新	4,259,312.00	0.72
9	002132	恒星科技	4,071,739.00	0.69
10	300640	德艺文创	3,931,173.00	0.67
11	300195	长荣股份	3,911,997.00	0.67
12	603036	如通股份	3,785,374.00	0.64
13	600531	豫光金铅	3,775,503.00	0.64
14	002792	通宇通讯	3,700,765.52	0.63
15	002343	慈文传媒	3,604,695.00	0.61
16	601390	中国中铁	3,600,836.00	0.61
17	603977	国泰集团	3,595,173.44	0.61
18	600436	片仔癀	3,387,915.00	0.58
19	300457	赢合科技	3,383,877.00	0.58
20	600287	江苏舜天	3,361,380.00	0.57

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,205,757,814.14
卖出股票收入（成交）总额	1,742,163,531.17

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建筑股份有限公司于 2022 年 01 月 06 日受到昆明水务局给予罚款 4 万元的行政处罚。中国建筑股份有限公司于 2022 年 06 月 24 日受到重庆住房与城乡建设局给予罚款 5.5 万元的行政处罚；

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

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,311,248.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,311,248.88

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
国金量化 精选 A	6,031	15,086.57	8,658,469.13	9.52	82,328,605.62	90.48
国金量化 精选 C	20,462	19,674.65	114,792,220.79	28.51	287,790,489.59	71.49
合计	26,493	18,630.20	123,450,689.92	25.01	370,119,095.21	74.99

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从 业人员持有本基金	国金量化精选 A	1,318,128.81	1.4487
	国金量化精选 C	284,975.31	0.0708
	合计	1,603,104.12	0.3248

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责 人持有本开放式基金	国金量化精选 A	10~50
	国金量化精选 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本 开放式基金	国金量化精选 A	>100
	国金量化精选 C	0
	合计	>100

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

注：无

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化精选 A	国金量化精选 C
----	----------	----------

基金合同生效日 (2022年3月18日) 基金份额总额	86,397,165.61	132,000,298.77
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	113,145,303.48	741,241,845.00
减:基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	108,555,394.34	470,659,433.39
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	90,987,074.75	402,582,710.38

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,邵海波先生自2022年1月28日起担任基金管理人总经理职务,原总经理尹庆军先生自2022年1月28日起担任基金管理人副董事长职务。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为40,000.00元人民币。截至本报告期末,该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:本报告期内,基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东海证券	2	3,947,513,401.18	100.00	2,071,107.23	100.00	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。

(1) 基金交易单元的选择标准如下：

- ①券商经纪人经营行为规范，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) 基金使用券商交易单元的选择程序如下：

- 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经济服务协议。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东海证券	-	-	1,981,777,000.00	100.00	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金量化精选混合型证券投资基金	规定披露媒体和本基金	2022年3月19日



	《基金合同生效公告》	基金管理人网站	
2	《关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 23 日
3	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 30 日
4	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 5 月 28 日
5	《关于国金量化精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、基金转换及定期定额投资业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 6 月 8 日
6	《国金基金管理有限公司关于提示投资者防止诈骗的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 7 月 15 日
7	《国金基金管理有限公司关于提示投资者防止诈骗的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 7 月 16 日
8	《国金量化精选混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 7 月 20 日
9	《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台费率优惠活动的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 8 月 22 日
10	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 8 月 23 日
11	《国金量化精选混合型证券投资基金 2022 年中期报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 8 月 30 日
12	《国金基金管理有限公司关于下线及第理财 APP 运营及维护服务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 9 月 14 日
13	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 9 月 30 日
14	《国金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 10 月 15 日
15	《国金量化精选混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 10 月 26 日
16	《国金基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 10 月 29 日

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

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金量化精选混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化精选混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化精选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。

### 13.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所。

### 13.3 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

2023年3月30日