

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录..... 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§ 2 基金简介..... 5

2.1 基金基本情况 5

2.2 基金产品说明 5

2.3 基金管理人和基金托管人 5

2.4 信息披露方式 6

2.5 其他相关资料 6

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6

3.2 基金净值表现 7

3.3 其他指标 9

§ 4 管理人报告..... 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 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 11

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§ 5 托管人报告..... 13

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 13

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 13

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 13

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13

6.2 利润表 15

6.3 净资产变动表 16

6.4 报表附注 19

§ 7 投资组合报告..... 39

7.1 期末基金资产组合情况 39

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 40

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 57

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 60

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 盈利投资者数量占比	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化多策略	
基金主代码	005443	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,870,319,790.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
下属分级基金的交易代码	005443	017874
报告期末下属分级基金的份额总额	1,515,111,199.28 份	3,355,208,591.28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、量化选股模型、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略。 本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。量化选股模型包括，多因子选股策略、统计套利策略、事件驱动套利策略、投资组合优化。 本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。
业绩比较基准	$80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中证全债指数收益率}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞志海	王茵
	联系电话	010-88005852	010-63639180
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595

传真	010-88005666	010-63639132
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100026	100033
法定代表人	邵海波	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
本期已实现收益	413, 105, 104. 78	896, 942, 943. 55
本期利润	423, 327, 661. 35	933, 574, 866. 03
加权平均基金份 额本期利润	0. 3181	0. 3210
本期加权平均净 值利润率	20. 01%	20. 44%
本期基金份额净 值增长率	22. 83%	22. 60%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	949, 526, 600. 29	2, 204, 140, 156. 65
期末可供分配基 金份额利润	0. 6267	0. 6569

期末基金资产净值	2,644,085,342.24	5,770,587,879.64
期末基金份额净值	1.7451	1.7199
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	115.47%	64.51%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多策略 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	17.90%	1.41%	9.78%	1.01%	8.12%	0.40%
过去六个月	22.83%	1.28%	6.58%	0.91%	16.25%	0.37%
过去一年	51.52%	1.21%	21.34%	0.81%	30.18%	0.40%
过去三年	68.05%	1.18%	28.59%	0.87%	39.46%	0.31%
过去五年	100.10%	1.15%	24.82%	0.80%	75.28%	0.35%
过去七年	165.03%	1.12%	50.00%	0.78%	115.03%	0.34%
自基金合同生效起至今	115.47%	1.14%	47.50%	0.80%	67.97%	0.34%

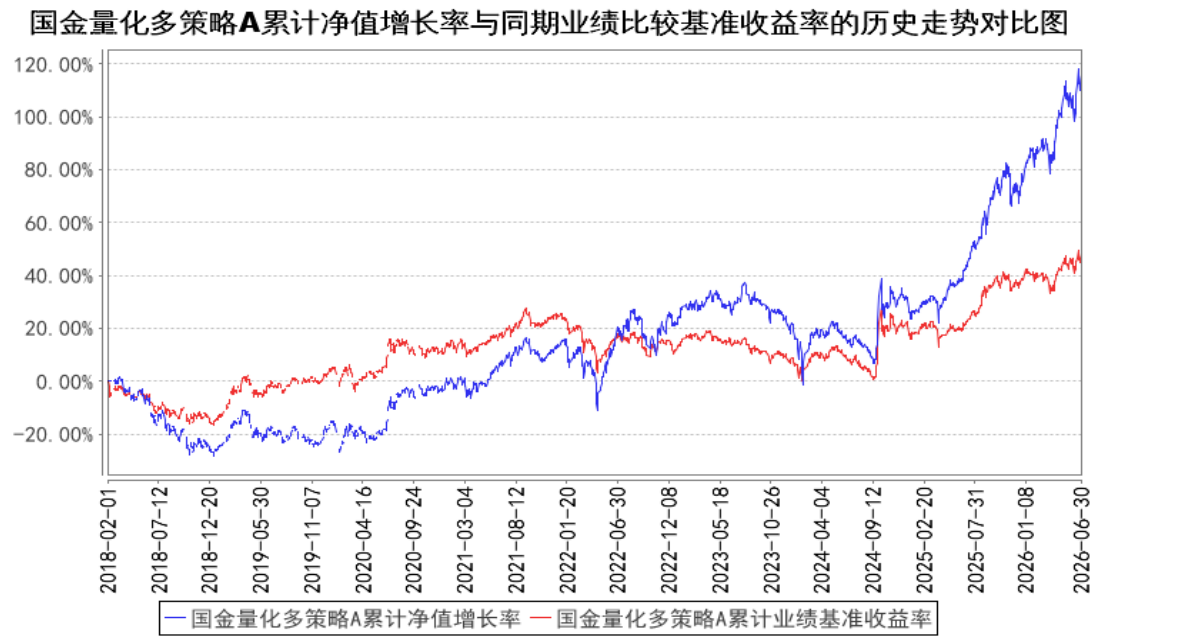
国金量化多策略 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

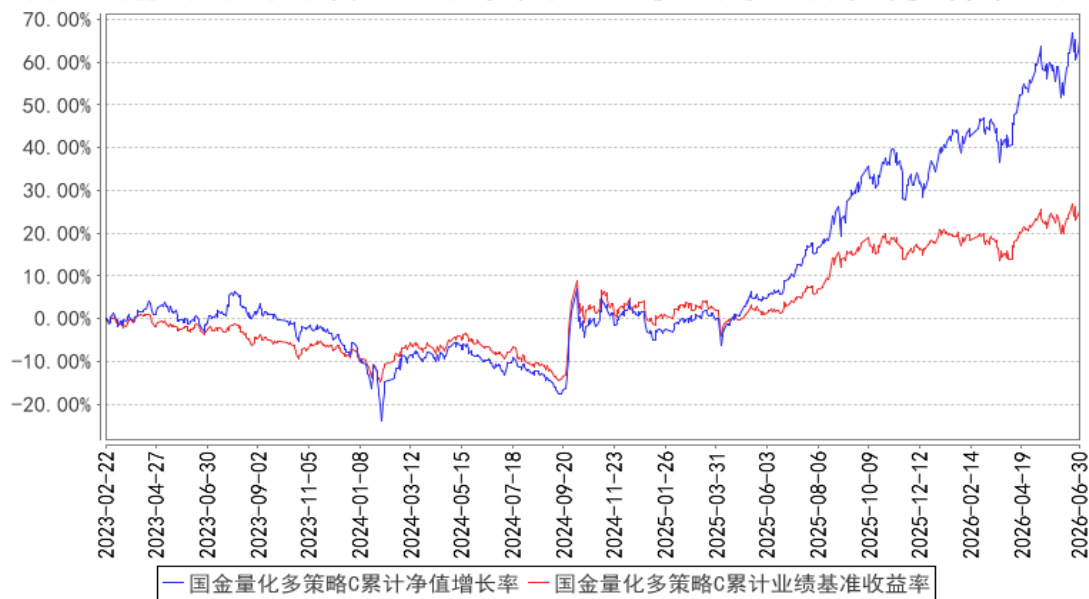
过去三个月	17.79%	1.41%	9.78%	1.01%	8.01%	0.40%
过去六个月	22.60%	1.28%	6.58%	0.91%	16.02%	0.37%
过去一年	50.93%	1.21%	21.34%	0.81%	29.59%	0.40%
过去三年	66.07%	1.18%	28.59%	0.87%	37.48%	0.31%
自基金合同生效 起至今	64.51%	1.14%	25.27%	0.84%	39.24%	0.30%

注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%”变更为“中证 500 指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%”；自 2024 年 1 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由“中证 500 指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%”变更为“沪深 300 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



国金量化多策略C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2023 年 2 月 22 日，图示日期为 2023 年 2 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

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 2026 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 34 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、

国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金、国金中证 A500 指数增强型证券投资基金、国金安瑞平衡混合型证券投资基金、国金红利量化选股混合型证券投资基金、国金中证全指指数增强型证券投资基金、国金安和债券型证券投资基金、国金智远量化选股混合型证券投资基金、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金、国金安裕债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2020 年 9 月 3 日	-	10 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在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，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在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，现任量化投资中心副总经理。
姚加红	本基金的基金经理	2023 年 1 月 5 日	-	22 年	姚加红先生，北京航空航天大学硕士。2004 年 4 月至 2011 年 5 月在博时基金管理有限公司任信息技术部高级程序员。2011 年 6 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部总经理、指数投资事业部副总经理，现任量化投资中心总经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
姚加红	公募基金	4	27,750,947,236.52	2023 年 1 月 5 日
	私募资产管理计划	4	1,180,214,056.19	2016 年 4 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	28,931,161,292.71	-

注：截至本报告期末，马芳女士不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场环境方面，上半年市场活跃度处于近五年较高水平。市场风格方面，贝塔值、动量和短期反转等市场风格因子在报告期内的波动高于其长期均值水平，但整体持续性较强，特别是动量

因子表现出相较历史类似时段更为极致的特征；报告期末，市值类因子的波动有所增大。行业涨跌方面，超半数中信一级行业在报告期内录得负收益，其中涨幅大于 40% 的行业为电子、通信和建材，跌幅较大的行业为消费者服务、综合金融、综合等。上半年市场持续受到宏观事件和 AI 叙事等多重因素影响，市场波动较大，各大类资产的波动均不同程度抬升。

报告期内，本基金的超额收益来源互补性较强，体现“多策略”的分散投资框架带来的优势。同时，风险模型对市场共同风险变动范围的约束有助于在波动较大的市场环境中保持超额收益的相对稳定性。

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 1.7451 元，累计单位净值为 2.0393 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 22.83%，同期业绩比较基准增长率为 6.58%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.7199 元，累计单位净值为 1.9199 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 22.60%，同期业绩比较基准增长率为 6.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在预期货币政策适度宽松、增量资金入场的背景下，市场流动性或保持充裕。上半年行情相对极致，市场经历较大幅度波动后，风格再平衡的可能性提升，行情有望逐步扩散，市场机会或趋于均衡，一定程度上利于量化基金超额收益的改善。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管人代表、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，并负责与托管人进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	486,534,279.08	415,734,436.99
结算备付金		0.05	0.05
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,640,550,429.18	4,812,933,576.16
其中：股票投资		7,640,550,429.18	4,812,933,576.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	423,038,000.00	213,611,486.64
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		24,075,049.33	25,336,550.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		8,574,197,757.64	5,467,616,050.17
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		147,694,512.14	256,041,800.35
应付管理人报酬		8,320,806.43	5,675,982.72
应付托管费		1,386,801.09	945,997.13
应付销售服务费		1,899,209.01	1,383,625.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	223,207.09	191,390.33
负债合计		159,524,535.76	264,238,796.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,870,319,790.56	3,695,261,284.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,544,353,431.32	1,508,115,970.02
净资产合计		8,414,673,221.88	5,203,377,254.05
负债和净资产总计		8,574,197,757.64	5,467,616,050.17

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，国金量化多策略 A 基金份额净值 1.7451 元，基金份额总额 1,515,111,199.28 份；国金量化多策略 C 基金份额净值 1.7199 元，基金份额总额 3,355,208,591.28 份。国金量化多策略份额总额合计为 4,870,319,790.56 份。

6.2 利润表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,412,070,178.50	89,111,536.63
1. 利息收入		1,235,231.40	164,323.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	587,453.30	148,162.13
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		647,778.10	16,161.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		1,357,337,585.93	47,315,531.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,315,893,294.22	34,213,390.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	41,444,291.71	13,102,140.71

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	46, 854, 479. 05	41, 101, 989. 97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	6, 642, 882. 12	529, 691. 34
减：二、营业总支出		55, 167, 651. 12	7, 590, 440. 63
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	39, 481, 642. 54	5, 590, 712. 22
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	6, 580, 273. 73	931, 785. 33
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	8, 997, 555. 90	966, 284. 43
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	108, 178. 95	101, 658. 65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 356, 902, 527. 38	81, 521, 096. 00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 356, 902, 527. 38	81, 521, 096. 00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 356, 902, 527. 38	81, 521, 096. 00

6.3 净资产变动表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3, 695, 261, 284. 03	-	1, 508, 115, 970. 02	5, 203, 377, 254. 05

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,695,261,284.03	-	1,508,115,970.02	5,203,377,254.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,175,058,506.53	-	2,036,237,461.30	3,211,295,967.83
(一)、综合收益总额	-	-	1,356,902,527.38	1,356,902,527.38
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,175,058,506.53	-	679,334,933.92	1,854,393,440.45
其中：1. 基金申购款	4,080,518,140.23	-	2,354,496,435.24	6,435,014,575.47
2. 基金赎回款	-2,905,459,633.70	-	-1,675,161,501.32	-4,580,621,135.02
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,870,319,790.56	-	3,544,353,431.32	8,414,673,221.88
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	900,242,142.67	-	179,807,096.29	1,080,049,238.9

				6
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	900,242,142.67	-	179,807,096.29	1,080,049,238.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	235,187,354.76	-	165,720,330.56	400,907,685.32
(一)、综合收益总额	-	-	81,521,096.00	81,521,096.00
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	235,187,354.76	-	84,199,234.56	319,386,589.32
其中：1. 基金申购款	807,140,239.09	-	203,786,572.52	1,010,926,811.61
2. 基金赎回款	-571,952,884.33	-	-119,587,337.96	-691,540,222.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,135,429,497.43	-	345,527,426.85	1,480,956,924.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1615 号文《关于准予国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效，本基金首次设立募集规模为 425,485,490.92 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于 2023 年 2 月 22 日增设 C 类基金份额类别，本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

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

本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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》、《公开募集

证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，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；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资

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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）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；

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附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	22,122,531.63
等于：本金	22,114,922.75
加：应计利息	7,608.88
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	464,411,747.45
等于：本金	464,402,512.80
加：应计利息	9,234.65
减：坏账准备	-
合计	486,534,279.08

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,599,061,041.15	-	7,640,550,429.18	41,489,388.03

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		7,599,061,041.15	-	7,640,550,429.18	41,489,388.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	423,038,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	423,038,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.8 其他资产

无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	29,999.14
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	103,678.95
其他	89,529.00
合计	223,207.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化多策略 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,084,187,098.69	1,084,187,098.69
本期申购	912,195,379.60	912,195,379.60
本期赎回（以“-”号填列）	-481,271,279.01	-481,271,279.01
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1, 515, 111, 199. 28	1, 515, 111, 199. 28

国金量化多策略 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2, 611, 074, 185. 34	2, 611, 074, 185. 34
本期申购	3, 168, 322, 760. 63	3, 168, 322, 760. 63
本期赎回（以“-”号填列）	-2, 424, 188, 354. 69	-2, 424, 188, 354. 69
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	3, 355, 208, 591. 28	3, 355, 208, 591. 28

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

6. 4. 7. 11 其他综合收益

无

6. 4. 7. 12 未分配利润

单位：人民币元

国金量化多策略 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	355, 704, 565. 63	100, 411, 580. 47	456, 116, 146. 10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	355, 704, 565. 63	100, 411, 580. 47	456, 116, 146. 10
本期利润	413, 105, 104. 78	10, 222, 556. 57	423, 327, 661. 35
本期基金份额交易产生的变动数	180, 716, 929. 88	68, 813, 405. 63	249, 530, 335. 51
其中：基金申购款	410, 597, 669. 20	131, 874, 169. 67	542, 471, 838. 87
基金赎回款	-229, 880, 739. 32	-63, 060, 764. 04	-292, 941, 503. 36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	949, 526, 600. 29	179, 447, 542. 67	1, 128, 974, 142. 96

国金量化多策略 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	954, 233, 196. 21	97, 766, 627. 71	1, 051, 999, 823. 92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	954, 233, 196. 21	97, 766, 627. 71	1, 051, 999, 823. 92
本期利润	896, 942, 943. 55	36, 631, 922. 48	933, 574, 866. 03

本期基金份额交易产生的变动数	352,964,016.89	76,840,581.52	429,804,598.41
其中：基金申购款	1,553,548,474.79	258,476,121.58	1,812,024,596.37
基金赎回款	-1,200,584,457.90	-181,635,540.06	-1,382,219,997.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,204,140,156.65	211,239,131.71	2,415,379,288.36

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	471,768.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	89,488.41
结算备付金利息收入	-
其他	26,196.28
合计	587,453.30

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,315,893,294.22
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	1,315,893,294.22

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	22,519,525,409.48
减：卖出股票成本总额	21,169,250,751.86
减：交易费用	34,381,363.40
买卖股票差价收入	1,315,893,294.22

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	41,444,291.71
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	41,444,291.71

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	46,854,479.05
股票投资	46,854,479.05
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	46,854,479.05

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,259,267.81
基金转换费收入	383,614.31
合计	6,642,882.12

6.4.7.22 信用减值损失

无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	108,178.95

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	39,481,642.54	5,590,712.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,245,693.96	1,946,461.75
应支付基金管理人的净管理费	28,235,948.58	3,644,250.47

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,580,273.73	931,785.33

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
国金基金管理有限公司	-	2,269,890.77	2,269,890.77
国金证券股份有限公司	-	248,576.76	248,576.76
中国光大银行股份有限公司	-	135,603.02	135,603.02
合计	-	2,654,070.55	2,654,070.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
国金基金管理有限公司	-	141,293.82	141,293.82
国金证券股份有限公司	-	16,995.29	16,995.29
中国光大银行股份有限公司	-	12,200.20	12,200.20
合计	-	170,489.31	170,489.31

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

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无

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

无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司－活期存款	22,122,531.63	471,768.61	67,575,124.17	77,231.76

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理办公会负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理办公会下设投资决策委员会和风险控制委员会，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。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

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

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

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实

具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的

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

6. 4. 13. 4 市场风险

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

6. 4. 13. 4. 1 利率风险

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

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

6. 4. 13. 4. 1. 1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	486, 534, 279. 08	-	-	-	-	-	486, 534, 279. 08
结算备付金	0. 05	-	-	-	-	-	0. 05
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	7, 640, 550, 429. 18	7, 640, 550, 429. 18
买入返售金融 资产	423, 038, 000. 00	-	-	-	-	-	423, 038, 000. 00
应收申购款	-	-	-	-	-	24, 075, 049. 33	24, 075, 049. 33
资产总计	909, 572, 279. 13	-	-	-	-	7, 664, 625, 478. 51	8, 574, 197, 757. 64

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	147,694,512.14	147,694,512.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,320,806.43	8,320,806.43
应付托管费	-	-	-	-	-	1,386,801.09	1,386,801.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,899,209.01	1,899,209.01
其他负债	-	-	-	-	-	223,207.09	223,207.09
负债总计	-	-	-	-	-	159,524,535.76	159,524,535.76
利率敏感度缺口	909,572,279.13	-	-	-	-	-7,505,100,942.75	8,414,673,221.88
上年度末 2025 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							
货币资金	415,734,436.99	-	-	-	-	-	415,734,436.99
结算备付金	0.05	-	-	-	-	-	0.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-4,812,933,576.16	-4,812,933,576.16
买入返售金融资产	213,611,486.64	-	-	-	-	-	213,611,486.64
应收申购款	-	-	-	-	-	25,336,550.33	25,336,550.33
资产总计	629,345,923.68	-	-	-	-	-4,838,270,126.49	5,467,616,050.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	256,041,800.35	256,041,800.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,675,982.72	5,675,982.72
应付托管费	-	-	-	-	-	945,997.13	945,997.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,383,625.59	1,383,625.59
其他负债	-	-	-	-	-	191,390.33	191,390.33
负债总计	-	-	-	-	-	264,238,796.12	264,238,796.12
利率敏感度缺口	629,345,923.68	-	-	-	-	-4,574,031,330.37	5,203,377,254.05

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	7,640,550,429.18	90.80	4,812,933,576.16	92.50
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	7,640,550,429.18	90.80	4,812,933,576.16	92.50

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数（000300.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沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	+5%	445,168,856.65	257,328,644.33
	-5%	-445,168,856.65	-257,328,644.33

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	7,640,550,429.18	4,812,933,576.16
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	7,640,550,429.18	4,812,933,576.16

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,640,550,429.18	89.11
	其中：股票	7,640,550,429.18	89.11
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	423,038,000.00	4.93
	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	486,534,279.13	5.67
8	其他各项资产	24,075,049.33	0.28
9	合计	8,574,197,757.64	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	31,422,787.40	0.37
B	采矿业	502,545,614.52	5.97
C	制造业	4,891,867,175.63	58.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	201,902,523.57	2.40
E	建筑业	52,186,300.00	0.62
F	批发和零售业	69,980,805.90	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	272,883,605.00	3.24
H	住宿和餐饮业	1,515,791.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	479,049,961.35	5.69
J	金融业	971,688,716.47	11.55
K	房地产业	5,347,893.00	0.06

L	租赁和商务服务业	6,175,640.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	122,624,443.10	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	14,065,681.94	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	774,180.30	0.01
Q	卫生和社会工作	4,598,374.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	8,099,532.00	0.10
S	综合	3,821,404.00	0.05
	合计	7,640,550,429.18	90.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	288,911	366,916,970.00	4.36
2	688256	寒武纪	173,549	276,906,106.95	3.29
3	000725	京东方 A	27,115,300	235,360,804.00	2.80
4	300059	东方财富	10,458,848	213,151,322.24	2.53
5	300014	亿纬锂能	2,744,208	178,455,846.24	2.12
6	002008	大族激光	956,972	143,651,066.92	1.71
7	002466	天齐锂业	2,294,896	140,723,022.72	1.67
8	300750	宁德时代	335,711	131,937,780.11	1.57
9	600584	长电科技	1,255,400	129,996,670.00	1.54
10	300033	同花顺	476,110	114,742,510.00	1.36
11	603259	药明康德	916,300	114,088,513.00	1.36
12	600150	中国船舶	3,258,748	110,113,094.92	1.31
13	002851	麦格米特	655,900	109,653,362.00	1.30
14	601288	农业银行	17,600,000	106,832,000.00	1.27
15	600362	江西铜业	2,361,000	102,231,300.00	1.21
16	301396	宏景科技	303,097	100,506,965.20	1.19
17	601688	华泰证券	4,686,400	96,633,568.00	1.15
18	300604	长川科技	277,053	94,591,435.26	1.12
19	601328	交通银行	12,810,600	82,372,158.00	0.98
20	300857	协创数据	236,722	80,461,807.80	0.96
21	600549	厦门钨业	921,700	78,528,840.00	0.93
22	002384	东山精密	291,500	76,475,025.00	0.91
23	002281	光迅科技	292,391	75,126,943.54	0.89
24	000630	铜陵有色	11,794,736	75,014,520.96	0.89
25	605117	德业股份	689,374	73,197,731.32	0.87
26	600309	万华化学	997,441	68,234,938.81	0.81

27	600919	江苏银行	6,161,300	66,418,814.00	0.79
28	300408	三环集团	388,515	64,843,153.50	0.77
29	600026	中远海能	3,535,800	63,432,252.00	0.75
30	600011	华能国际	8,024,966	60,909,491.94	0.72
31	601628	中国人寿	1,702,336	60,177,577.60	0.72
32	002600	领益智造	3,439,200	59,635,728.00	0.71
33	600418	江淮汽车	2,241,000	57,885,030.00	0.69
34	600547	山东黄金	2,505,175	57,844,490.75	0.69
35	600519	贵州茅台	47,540	56,358,194.60	0.67
36	002916	深南电路	120,628	55,235,561.20	0.66
37	300870	欧陆通	156,400	54,065,916.00	0.64
38	600489	中金黄金	2,898,200	52,312,510.00	0.62
39	601225	陕西煤业	2,535,643	51,600,335.05	0.61
40	002812	恩捷股份	753,534	50,418,959.94	0.60
41	300438	鹏辉能源	595,701	49,353,827.85	0.59
42	603799	华友钴业	1,012,299	48,853,549.74	0.58
43	600188	兖矿能源	2,737,590	48,646,974.30	0.58
44	603993	洛阳钼业	2,758,802	48,416,975.10	0.58
45	300548	长芯博创	172,800	48,038,400.00	0.57
46	600893	航发动力	1,218,100	46,701,954.00	0.56
47	300274	阳光电源	276,700	44,000,834.00	0.52
48	688120	华海清科	133,436	42,990,410.48	0.51
49	001389	广合科技	178,600	42,372,850.00	0.50
50	688126	沪硅产业	1,057,210	42,172,106.90	0.50
51	301358	湖南裕能	516,753	39,206,050.11	0.47
52	300769	德方纳米	580,880	38,628,520.00	0.46
53	600115	中国东航	9,880,900	37,646,229.00	0.45
54	600160	巨化股份	707,200	37,488,672.00	0.45
55	002185	华天科技	1,604,300	35,791,933.00	0.43
56	688008	澜起科技	112,721	34,932,237.90	0.42
57	300475	香农芯创	115,000	34,500,000.00	0.41
58	301377	鼎泰高科	59,820	32,954,838.00	0.39
59	601919	中远海控	2,444,100	32,408,766.00	0.39
60	688409	富创精密	104,651	32,049,368.75	0.38
61	601816	京沪高铁	6,923,100	31,361,643.00	0.37
62	601857	中国石油	3,610,732	31,341,153.76	0.37
63	300395	菲利华	232,682	31,116,563.86	0.37
64	601009	南京银行	3,100,872	30,667,624.08	0.36
65	301536	星宸科技	238,000	30,632,980.00	0.36
66	002493	荣盛石化	2,821,600	30,332,200.00	0.36
67	601233	桐昆股份	1,252,509	27,116,819.85	0.32
68	688390	固德威	241,183	26,170,767.33	0.31
69	688127	蓝特光学	256,722	25,056,067.20	0.30

70	688469	芯联集成	2,316,162	24,574,478.82	0.29
71	002714	牧原股份	698,300	24,433,517.00	0.29
72	000657	中钨高新	252,100	24,131,012.00	0.29
73	601898	中煤能源	1,965,525	23,940,094.50	0.28
74	600029	南方航空	4,593,500	23,794,330.00	0.28
75	600938	中国海油	873,000	23,701,950.00	0.28
76	600926	杭州银行	1,472,767	21,281,483.15	0.25
77	301086	鸿富瀚	100,420	21,015,897.60	0.25
78	000975	山金国际	1,228,300	20,881,100.00	0.25
79	301018	申菱环境	175,720	20,314,989.20	0.24
80	688052	纳芯微	69,925	20,160,076.75	0.24
81	601319	中国人保	2,949,900	19,941,324.00	0.24
82	688268	华特气体	73,569	19,679,707.50	0.23
83	600497	驰宏锌锗	1,599,400	19,368,734.00	0.23
84	002460	赣锋锂业	294,480	19,258,992.00	0.23
85	600989	宝丰能源	942,020	19,151,266.60	0.23
86	600961	株冶集团	581,900	18,847,741.00	0.22
87	688003	天准科技	143,128	18,220,194.40	0.22
88	688506	百利天恒	58,586	17,226,041.58	0.20
89	002821	凯莱英	106,100	17,188,200.00	0.20
90	601869	长飞光纤	31,400	17,141,260.00	0.20
91	002080	中材科技	190,400	17,136,000.00	0.20
92	600578	京能电力	2,647,000	17,073,150.00	0.20
93	300919	中伟新材	389,600	17,045,000.00	0.20
94	600183	生益科技	97,800	16,958,520.00	0.20
95	601111	中国国航	2,776,500	16,797,825.00	0.20
96	600795	国电电力	3,530,300	16,486,501.00	0.20
97	600346	恒力石化	930,700	16,482,697.00	0.20
98	600875	东方电气	566,600	16,301,082.00	0.19
99	000301	东方盛虹	1,412,100	16,168,545.00	0.19
100	601699	潞安环能	1,131,300	16,154,964.00	0.19
101	000333	美的集团	212,215	16,028,598.95	0.19
102	601229	上海银行	1,829,700	15,881,796.00	0.19
103	002938	鹏鼎控股	145,900	15,374,942.00	0.18
104	000983	山西焦煤	2,630,400	15,256,320.00	0.18
105	002294	信立泰	477,500	15,227,475.00	0.18
106	600015	华夏银行	2,343,900	14,977,521.00	0.18
107	600378	昊华科技	196,300	14,797,094.00	0.18
108	002850	科达利	77,900	14,746,470.00	0.18
109	002379	宏桥控股	980,200	14,477,554.00	0.17
110	600233	圆通速递	913,900	14,393,925.00	0.17
111	001203	大中矿业	478,300	14,325,085.00	0.17
112	603929	亚翔集成	52,500	14,281,050.00	0.17

113	601077	渝农商行	2,306,400	14,092,104.00	0.17
114	003031	中瓷电子	75,500	13,612,650.00	0.16
115	688692	达梦数据	55,477	13,552,476.33	0.16
116	601001	晋控煤业	759,600	13,209,444.00	0.16
117	002064	华峰化学	1,388,000	13,172,120.00	0.16
118	002353	杰瑞股份	84,900	12,947,250.00	0.15
119	601336	新华保险	206,600	12,325,756.00	0.15
120	601390	中国中铁	2,946,400	12,286,488.00	0.15
121	600500	中化国际	1,512,100	11,839,743.00	0.14
122	603256	宏和科技	44,600	11,833,718.00	0.14
123	002402	和而泰	448,100	11,574,423.00	0.14
124	600482	中国动力	349,999	11,479,967.20	0.14
125	601668	中国建筑	2,579,100	11,193,294.00	0.13
126	601958	金钼股份	393,100	11,050,041.00	0.13
127	600985	淮北矿业	772,100	10,848,005.00	0.13
128	300207	欣旺达	569,600	10,816,704.00	0.13
129	603260	合盛硅业	223,300	10,776,458.00	0.13
130	300765	石药创新	394,900	10,753,127.00	0.13
131	600023	浙能电力	1,980,900	10,419,534.00	0.12
132	603156	养元饮品	204,600	10,039,722.00	0.12
133	601985	中国核电	1,101,000	9,942,030.00	0.12
134	601021	春秋航空	217,100	9,895,418.00	0.12
135	688361	中科飞测	21,641	9,305,630.00	0.11
136	002414	高德红外	697,300	9,246,198.00	0.11
137	000683	博源化工	1,598,800	9,209,088.00	0.11
138	000338	潍柴动力	337,200	9,188,700.00	0.11
139	300803	指南针	93,800	8,598,646.00	0.10
140	688628	优利德	86,746	8,582,649.24	0.10
141	600863	华能蒙电	1,816,200	8,536,140.00	0.10
142	600352	浙江龙盛	704,800	8,535,128.00	0.10
143	000729	燕京啤酒	836,800	8,476,784.00	0.10
144	300861	美畅股份	322,800	8,131,332.00	0.10
145	301205	联特科技	24,200	8,085,220.00	0.10
146	002558	巨人网络	291,000	8,019,960.00	0.10
147	301362	民爆光电	42,913	7,892,558.96	0.09
148	688331	荣昌生物	60,425	7,870,960.50	0.09
149	000617	中油资本	1,190,500	7,845,395.00	0.09
150	688433	华曙高科	91,642	7,844,555.20	0.09
151	300681	英搏尔	274,000	7,841,880.00	0.09
152	603659	璞泰来	269,500	7,796,635.00	0.09
153	603225	新凤鸣	396,500	7,791,225.00	0.09
154	688025	杰普特	16,556	7,781,320.00	0.09
155	688375	国博电子	73,982	7,716,322.60	0.09

156	301345	涛涛车业	33,100	7,646,100.00	0.09
157	601012	隆基绿能	582,656	7,644,446.72	0.09
158	601666	平煤股份	1,064,000	7,607,600.00	0.09
159	600348	华阳股份	989,550	7,570,057.50	0.09
160	688279	峰岬科技	33,665	7,555,772.60	0.09
161	600039	四川路桥	962,400	7,525,968.00	0.09
162	600031	三一重工	426,315	7,366,723.20	0.09
163	300454	深信服	75,685	7,280,897.00	0.09
164	002324	普利特	588,800	7,106,816.00	0.08
165	002203	海亮股份	306,300	6,998,955.00	0.08
166	603345	安井食品	86,300	6,920,397.00	0.08
167	000543	皖能电力	904,805	6,849,373.85	0.08
168	600018	上港集团	1,430,700	6,752,904.00	0.08
169	001286	陕西能源	660,000	6,692,400.00	0.08
170	300257	开山股份	232,300	6,662,364.00	0.08
171	603124	江南新材	34,200	6,394,716.00	0.08
172	600361	创新新材	1,771,300	6,376,680.00	0.08
173	688633	星球石墨	213,215	6,338,881.95	0.08
174	300073	当升科技	129,510	6,221,660.40	0.07
175	688502	茂莱光学	8,952	6,209,107.20	0.07
176	603638	艾迪精密	264,700	6,207,215.00	0.07
177	003022	联泓新科	239,100	6,192,690.00	0.07
178	000039	中集集团	763,200	6,189,552.00	0.07
179	601899	紫金矿业	244,384	6,143,813.76	0.07
180	600025	华能水电	679,300	6,038,977.00	0.07
181	600256	广汇能源	1,186,700	5,862,298.00	0.07
182	603379	三美股份	76,900	5,835,941.00	0.07
183	688392	骄成超声	25,508	5,794,907.44	0.07
184	601609	金田股份	527,800	5,700,240.00	0.07
185	000810	创维数字	422,300	5,595,475.00	0.07
186	300855	图南股份	178,698	5,586,099.48	0.07
187	000629	钒钛股份	1,663,300	5,555,422.00	0.07
188	002488	金固股份	623,500	5,555,385.00	0.07
189	601128	常熟银行	943,320	5,490,122.40	0.07
190	600801	华新建材	351,400	5,481,840.00	0.07
191	601061	中信金属	504,500	5,433,465.00	0.06
192	600879	航天电子	254,600	5,420,434.00	0.06
193	002838	道恩股份	176,200	5,395,244.00	0.06
194	600816	建元信托	2,190,900	5,345,796.00	0.06
195	600028	中国石化	1,189,000	5,302,940.00	0.06
196	600483	福能股份	515,600	5,253,964.00	0.06
197	600098	广州发展	883,100	5,219,121.00	0.06
198	600688	上海石化	1,697,000	4,972,210.00	0.06

199	301606	绿联科技	80,300	4,899,906.00	0.06
200	300661	圣邦股份	33,400	4,792,232.00	0.06
201	002643	万润股份	227,900	4,774,505.00	0.06
202	601677	明泰铝业	286,600	4,757,560.00	0.06
203	688667	菱电电控	35,576	4,754,732.40	0.06
204	000738	航发控制	259,000	4,737,110.00	0.06
205	002078	太阳纸业	379,200	4,736,208.00	0.06
206	688063	派能科技	88,840	4,732,506.80	0.06
207	301626	苏州天脉	12,300	4,722,708.00	0.06
208	601865	福莱特	446,900	4,696,919.00	0.06
209	603737	三棵树	194,340	4,683,594.00	0.06
210	603317	天味食品	359,800	4,680,998.00	0.06
211	002153	石基信息	646,400	4,673,472.00	0.06
212	002444	巨星科技	150,200	4,671,220.00	0.06
213	603171	税友股份	116,500	4,642,525.00	0.06
214	601106	中国一重	1,404,900	4,636,170.00	0.06
215	000600	建投能源	529,800	4,635,750.00	0.06
216	600019	宝钢股份	843,400	4,579,662.00	0.05
217	600236	桂冠电力	521,600	4,579,648.00	0.05
218	600873	梅花生物	622,100	4,572,435.00	0.05
219	002948	青岛银行	899,500	4,569,460.00	0.05
220	601216	君正集团	1,007,400	4,493,004.00	0.05
221	600583	海油工程	877,300	4,412,819.00	0.05
222	002608	江苏国信	566,600	3,909,540.00	0.05
223	001280	中国铀业	58,300	3,888,610.00	0.05
224	688536	思瑞浦	10,653	3,878,650.77	0.05
225	601717	中创智领	278,800	3,878,108.00	0.05
226	000778	新兴铸管	1,043,700	3,872,127.00	0.05
227	002945	华林证券	287,330	3,858,841.90	0.05
228	603730	岱美股份	344,500	3,848,065.00	0.05
229	300054	鼎龙股份	36,300	3,846,711.00	0.05
230	300003	乐普医疗	324,300	3,842,955.00	0.05
231	301308	江波龙	5,438	3,827,264.40	0.05
232	600673	东阳光	113,800	3,821,404.00	0.05
233	603298	杭叉集团	159,800	3,812,828.00	0.05
234	603986	兆易创新	4,650	3,789,750.00	0.05
235	601000	唐山港	907,300	3,765,295.00	0.04
236	601298	青岛港	466,900	3,758,545.00	0.04
237	000552	甘肃能化	1,668,400	3,737,216.00	0.04
238	600332	白云山	185,300	3,713,412.00	0.04
239	600968	海油发展	1,110,700	3,698,631.00	0.04
240	601963	重庆银行	362,500	3,654,000.00	0.04
241	600901	江苏金租	635,000	3,651,250.00	0.04

242	601882	海天精工	167,600	3,390,548.00	0.04
243	300428	立中集团	177,800	3,232,404.00	0.04
244	601238	广汽集团	635,600	3,228,848.00	0.04
245	688631	莱斯信息	68,693	3,222,388.63	0.04
246	688567	孚能科技	306,383	3,217,021.50	0.04
247	600316	洪都航空	114,900	3,210,306.00	0.04
248	605499	东鹏饮料	25,960	3,204,242.80	0.04
249	688615	合合信息	28,138	3,182,407.80	0.04
250	688309	恒誉环保	52,205	3,178,240.40	0.04
251	601567	三星电气	210,900	3,150,846.00	0.04
252	000959	首钢股份	889,800	3,123,198.00	0.04
253	600887	伊利股份	130,300	3,121,988.00	0.04
254	301363	美好医疗	170,160	3,119,032.80	0.04
255	600299	安迪苏	395,200	3,102,320.00	0.04
256	601399	国机重装	885,100	3,097,850.00	0.04
257	000825	太钢不锈	908,400	3,097,644.00	0.04
258	603786	科博达	75,600	3,092,796.00	0.04
259	600956	新天绿能	442,200	3,090,978.00	0.04
260	002478	常宝股份	500,100	3,090,618.00	0.04
261	600390	五矿资本	676,400	3,084,384.00	0.04
262	601156	东航物流	191,300	3,083,756.00	0.04
263	000893	亚钾国际	75,400	3,083,106.00	0.04
264	600428	中远海特	393,300	3,071,673.00	0.04
265	600572	康恩贝	783,100	3,069,752.00	0.04
266	002736	国信证券	307,000	3,066,930.00	0.04
267	603806	福斯特	182,600	3,065,854.00	0.04
268	001289	龙源电力	195,700	3,058,791.00	0.04
269	688027	国盾量子	6,048	3,048,252.48	0.04
270	600369	西南证券	757,000	3,043,140.00	0.04
271	000598	兴蓉环境	473,700	3,041,154.00	0.04
272	002698	博实股份	251,700	3,038,019.00	0.04
273	002958	青农商行	1,107,100	3,033,454.00	0.04
274	000883	湖北能源	700,800	3,027,456.00	0.04
275	000686	东北证券	359,600	3,020,640.00	0.04
276	600502	安徽建工	693,200	3,015,420.00	0.04
277	002320	海峡股份	479,900	3,008,973.00	0.04
278	002831	裕同科技	83,931	2,984,586.36	0.04
279	003816	中国广核	761,700	2,978,247.00	0.04
280	601187	厦门银行	425,800	2,908,214.00	0.03
281	603323	苏农银行	693,430	2,683,574.10	0.03
282	301285	鸿日达	24,200	2,669,986.00	0.03
283	301268	铭利达	187,300	2,618,454.00	0.03
284	301280	珠城科技	51,300	2,594,241.00	0.03

285	000553	安道麦 A	482,100	2,579,235.00	0.03
286	688531	日联科技	14,461	2,571,744.24	0.03
287	000619	海螺新材	556,300	2,447,720.00	0.03
288	688188	柏楚电子	22,838	2,436,814.60	0.03
289	688586	江航装备	208,000	2,431,520.00	0.03
290	600562	国睿科技	114,000	2,419,080.00	0.03
291	301286	侨源股份	41,600	2,412,384.00	0.03
292	688351	微电生理	106,269	2,408,055.54	0.03
293	300183	东软载波	230,300	2,406,635.00	0.03
294	301149	隆华新材	227,400	2,405,892.00	0.03
295	688281	华秦科技	47,736	2,397,779.28	0.03
296	600135	乐凯胶片	299,900	2,396,201.00	0.03
297	688475	萤石网络	87,425	2,391,073.75	0.03
298	002318	久立特材	99,700	2,382,830.00	0.03
299	603995	甬金股份	102,500	2,379,025.00	0.03
300	688228	开普云	30,698	2,374,183.32	0.03
301	301631	壹连科技	32,980	2,369,942.80	0.03
302	001313	粤海饲料	334,100	2,368,769.00	0.03
303	600301	华锡有色	38,600	2,366,952.00	0.03
304	688114	华大智造	46,331	2,366,587.48	0.03
305	000932	华菱钢铁	682,000	2,366,540.00	0.03
306	688612	威迈斯	79,938	2,365,365.42	0.03
307	688101	三达膜	142,975	2,363,376.75	0.03
308	605066	天正电气	348,000	2,362,920.00	0.03
309	688516	奥特维	41,066	2,356,777.74	0.03
310	301090	华润材料	375,500	2,354,385.00	0.03
311	300487	蓝晓科技	40,000	2,354,000.00	0.03
312	002921	联诚精密	85,800	2,345,772.00	0.03
313	600835	上海机电	113,700	2,342,220.00	0.03
314	688002	睿创微纳	15,134	2,341,078.46	0.03
315	603486	科沃斯	46,100	2,339,575.00	0.03
316	601579	会稽山	158,900	2,334,241.00	0.03
317	601608	中信重工	488,600	2,330,622.00	0.03
318	600166	福田汽车	800,800	2,330,328.00	0.03
319	002833	弘亚数控	120,800	2,330,232.00	0.03
320	002120	韵达股份	366,100	2,328,396.00	0.03
321	002243	力合科创	354,300	2,327,751.00	0.03
322	002928	华夏航空	332,900	2,326,971.00	0.03
323	600458	时代新材	140,600	2,326,930.00	0.03
324	002545	东方铁塔	143,400	2,325,948.00	0.03
325	000923	河钢资源	187,400	2,325,634.00	0.03
326	688100	威胜信息	75,974	2,324,044.66	0.03
327	002010	传化智联	519,800	2,323,506.00	0.03

328	603095	越剑智能	162,200	2,322,704.00	0.03
329	301091	深城交	149,700	2,320,350.00	0.03
330	688371	菲沃泰	59,464	2,318,501.36	0.03
331	600929	雪天盐业	510,600	2,318,124.00	0.03
332	603198	迎驾贡酒	78,300	2,317,680.00	0.03
333	002967	广电计量	128,400	2,317,620.00	0.03
334	688443	智翔金泰	99,638	2,316,583.50	0.03
335	301041	金百泽	68,600	2,315,250.00	0.03
336	600637	东方明珠	278,600	2,315,166.00	0.03
337	600496	精工钢构	746,200	2,313,220.00	0.03
338	600998	九州通	493,200	2,313,108.00	0.03
339	002075	沙钢股份	679,900	2,311,660.00	0.03
340	600764	中国海防	132,600	2,311,218.00	0.03
341	000921	海信家电	84,500	2,308,540.00	0.03
342	001236	弘业期货	332,100	2,308,095.00	0.03
343	603337	杰克科技	63,700	2,307,851.00	0.03
344	301039	中集车辆	327,300	2,307,465.00	0.03
345	600037	歌华有线	368,000	2,307,360.00	0.03
346	002044	美年健康	458,400	2,305,752.00	0.03
347	000589	贵州轮胎	567,500	2,304,050.00	0.03
348	002926	华西证券	282,000	2,303,940.00	0.03
349	600517	国网英大	492,100	2,303,028.00	0.03
350	601375	中原证券	576,400	2,299,836.00	0.03
351	603613	国联股份	124,800	2,298,816.00	0.03
352	000750	国海证券	624,500	2,298,160.00	0.03
353	603519	立霸股份	150,200	2,298,060.00	0.03
354	000800	一汽解放	385,100	2,291,345.00	0.03
355	603757	大元泵业	30,200	2,287,952.00	0.03
356	002004	华邦健康	581,800	2,286,474.00	0.03
357	000157	中联重科	326,900	2,278,493.00	0.03
358	000166	申万宏源	515,300	2,267,320.00	0.03
359	601577	长沙银行	260,100	2,265,471.00	0.03
360	002939	长城证券	271,600	2,265,144.00	0.03
361	600006	东风股份	441,400	2,264,382.00	0.03
362	002033	丽江股份	273,669	2,260,505.94	0.03
363	300498	温氏股份	182,600	2,249,632.00	0.03
364	600575	淮河能源	696,600	2,222,154.00	0.03
365	002541	鸿路钢构	124,800	2,161,536.00	0.03
366	600566	济川药业	86,700	1,923,873.00	0.02
367	600966	博汇纸业	395,400	1,890,012.00	0.02
368	600168	武汉控股	449,200	1,814,768.00	0.02
369	600737	中粮糖业	144,500	1,781,685.00	0.02
370	603950	长源东谷	20,200	1,705,486.00	0.02

371	002624	完美世界	136,500	1,695,330.00	0.02
372	301260	格力博	124,900	1,687,399.00	0.02
373	001314	亿道信息	27,100	1,674,780.00	0.02
374	603125	常青科技	50,700	1,659,918.00	0.02
375	300694	蠡湖股份	171,100	1,642,560.00	0.02
376	688153	唯捷创芯	50,961	1,636,867.32	0.02
377	300195	长荣股份	276,100	1,620,707.00	0.02
378	002449	国星光电	207,600	1,608,900.00	0.02
379	603712	七一二	124,200	1,600,938.00	0.02
380	002266	浙富控股	315,300	1,595,418.00	0.02
381	688685	迈信林	29,060	1,595,394.00	0.02
382	301314	科瑞思	32,600	1,586,316.00	0.02
383	003027	同兴科技	90,700	1,580,901.00	0.02
384	603915	国茂股份	111,300	1,579,347.00	0.02
385	601965	中国汽研	132,000	1,578,720.00	0.02
386	300502	新易盛	2,600	1,578,200.00	0.02
387	000539	粤电力 A	231,100	1,573,791.00	0.02
388	000758	中色股份	239,400	1,572,858.00	0.02
389	002687	乔治白	299,900	1,571,476.00	0.02
390	300034	钢研高纳	91,600	1,570,024.00	0.02
391	301608	博实结	31,200	1,568,112.00	0.02
392	000997	新大陆	96,200	1,568,060.00	0.02
393	300768	迪普科技	113,800	1,567,026.00	0.02
394	002226	江南化工	349,000	1,567,010.00	0.02
395	600830	香溢融通	196,600	1,566,902.00	0.02
396	601168	西部矿业	57,700	1,565,978.00	0.02
397	605118	力鼎光电	44,800	1,563,072.00	0.02
398	600749	西藏旅游	114,000	1,561,800.00	0.02
399	605016	百龙创园	60,400	1,561,340.00	0.02
400	000951	中国重汽	80,000	1,560,800.00	0.02
401	600582	天地科技	350,500	1,559,725.00	0.02
402	300702	天宇股份	77,300	1,558,368.00	0.02
403	600981	苏豪汇鸿	692,600	1,558,350.00	0.02
404	603856	东宏股份	112,600	1,557,258.00	0.02
405	603833	欧派家居	51,700	1,556,687.00	0.02
406	002773	康弘药业	76,084	1,555,917.80	0.02
407	600969	郴电国际	203,906	1,555,802.78	0.02
408	603132	金徽股份	99,800	1,554,884.00	0.02
409	002434	万里扬	257,000	1,554,850.00	0.02
410	001319	铭科精技	79,300	1,554,280.00	0.02
411	002686	亿利达	301,800	1,554,270.00	0.02
412	300381	溢多利	276,500	1,553,930.00	0.02
413	301061	匠心家居	44,300	1,553,601.00	0.02

414	300638	广和通	83,900	1,552,989.00	0.02
415	603767	中马传动	109,200	1,552,824.00	0.02
416	600618	氯碱化工	154,500	1,552,725.00	0.02
417	603979	金诚信	26,300	1,552,489.00	0.02
418	300856	科思股份	145,600	1,552,096.00	0.02
419	600511	国药股份	59,600	1,551,984.00	0.02
420	688065	凯赛生物	32,420	1,551,297.00	0.02
421	605162	新中港	201,200	1,551,252.00	0.02
422	605086	龙高股份	62,500	1,551,250.00	0.02
423	603355	莱克电气	58,800	1,551,144.00	0.02
424	300176	鸿特科技	319,800	1,551,030.00	0.02
425	300965	恒宇信通	36,600	1,550,376.00	0.02
426	000550	江铃汽车	95,500	1,549,010.00	0.02
427	002265	建设工业	89,000	1,548,600.00	0.02
428	601068	中铝国际	358,400	1,548,288.00	0.02
429	000058	深赛格	252,100	1,547,894.00	0.02
430	605189	富春染织	128,385	1,547,039.25	0.02
431	603338	浙江鼎力	36,400	1,547,000.00	0.02
432	603700	宁水集团	133,200	1,546,452.00	0.02
433	601555	东吴证券	195,200	1,545,984.00	0.02
434	002653	海思科	23,300	1,545,722.00	0.02
435	002803	吉宏股份	59,800	1,545,232.00	0.02
436	603390	通达电气	148,000	1,545,120.00	0.02
437	688248	南网科技	22,295	1,542,368.10	0.02
438	002540	亚太科技	330,200	1,542,034.00	0.02
439	601199	江南水务	278,300	1,541,782.00	0.02
440	603680	今创集团	157,100	1,541,151.00	0.02
441	000757	浩物股份	451,900	1,540,979.00	0.02
442	603105	芯能科技	225,900	1,538,379.00	0.02
443	600621	华鑫股份	119,000	1,537,480.00	0.02
444	001311	多利科技	95,300	1,537,189.00	0.02
445	600955	维远股份	104,400	1,536,768.00	0.02
446	000798	中水渔业	217,600	1,536,256.00	0.02
447	002758	浙农股份	194,400	1,535,760.00	0.02
448	601966	玲珑轮胎	150,700	1,535,633.00	0.02
449	300140	节能环保	308,600	1,533,742.00	0.02
450	603882	金域医学	68,200	1,533,136.00	0.02
451	000719	中原传媒	134,100	1,532,763.00	0.02
452	002110	三钢闽光	532,000	1,532,160.00	0.02
453	000919	金陵药业	262,800	1,532,124.00	0.02
453	601990	南京证券	233,200	1,532,124.00	0.02
454	300973	立高食品	62,300	1,530,711.00	0.02
455	002500	山西证券	296,600	1,530,456.00	0.02

456	603070	万控智造	121,600	1,529,728.00	0.02
457	000881	中广核技	236,000	1,529,280.00	0.02
458	600426	华鲁恒升	63,900	1,528,488.00	0.02
459	603885	吉祥航空	148,500	1,528,065.00	0.02
460	000563	陕国投 A	553,100	1,526,556.00	0.02
461	601500	通用股份	418,200	1,526,430.00	0.02
462	002390	信邦制药	584,800	1,526,328.00	0.02
463	603507	振江股份	46,400	1,526,096.00	0.02
464	000708	中信特钢	120,900	1,525,758.00	0.02
465	300601	康泰生物	134,500	1,525,230.00	0.02
466	600269	赣粤高速	383,200	1,525,136.00	0.02
467	000597	东北制药	359,700	1,525,128.00	0.02
468	600354	敦煌种业	320,300	1,524,628.00	0.02
469	601777	千里科技	186,600	1,522,656.00	0.02
470	002671	龙泉股份	410,300	1,522,213.00	0.02
471	688295	中复神鹰	25,142	1,522,096.68	0.02
472	603530	神马电力	29,900	1,521,910.00	0.02
473	600095	湘财股份	202,100	1,521,813.00	0.02
474	603707	健友股份	215,200	1,521,464.00	0.02
475	301051	信濠光电	78,380	1,520,572.00	0.02
476	603367	辰欣药业	118,300	1,517,789.00	0.02
477	603711	香飘飘	136,400	1,515,404.00	0.02
478	002673	西部证券	233,300	1,514,117.00	0.02
479	000156	华数传媒	239,800	1,513,138.00	0.02
480	000403	派林生物	171,976	1,511,669.04	0.02
481	601228	广州港	535,600	1,510,392.00	0.02
482	002737	葵花药业	134,600	1,508,866.00	0.02
483	001218	丽臣实业	68,300	1,506,698.00	0.02
484	600064	南京高科	211,300	1,506,569.00	0.02
485	603939	益丰药房	83,700	1,504,926.00	0.02
486	002666	德联集团	380,800	1,504,160.00	0.02
487	600908	无锡银行	296,000	1,503,680.00	0.02
488	601598	中国外运	302,500	1,500,400.00	0.02
489	600377	宁沪高速	129,000	1,492,530.00	0.02
490	600461	洪城环境	163,900	1,484,934.00	0.02
491	600903	贵州燃气	223,600	1,484,704.00	0.02
492	600928	西安银行	449,800	1,470,846.00	0.02
493	603057	紫燕食品	65,800	1,467,340.00	0.02
494	605001	威奥股份	268,500	1,463,325.00	0.02
495	603385	惠达卫浴	295,600	1,442,528.00	0.02
496	603096	新经典	106,200	1,420,956.00	0.02
497	000812	陕西金叶	440,000	1,364,000.00	0.02
498	300535	达威股份	97,500	1,328,925.00	0.02

499	603999	读者传媒	263,500	1,317,500.00	0.02
500	002999	天禾股份	233,100	1,240,092.00	0.01
501	603708	家家悦	142,600	1,223,508.00	0.01
502	600523	贵航股份	109,900	1,159,445.00	0.01
503	002238	天威视讯	212,000	1,144,800.00	0.01
504	603808	歌力思	148,500	1,124,145.00	0.01
505	603022	新通联	116,600	931,634.00	0.01
506	002566	益盛药业	154,200	931,368.00	0.01
507	300929	华骐环保	86,600	912,764.00	0.01
508	688728	格科微	43,252	910,022.08	0.01
509	688083	中望软件	13,192	854,182.00	0.01
510	002849	威星智能	49,600	839,232.00	0.01
511	688558	国盛智科	25,383	834,085.38	0.01
512	603100	川仪股份	45,800	826,690.00	0.01
513	301275	汉朔科技	18,300	821,670.00	0.01
514	688563	航材股份	15,999	819,628.77	0.01
515	001379	腾达科技	52,200	819,540.00	0.01
516	002841	视源股份	23,600	814,908.00	0.01
517	600129	太极集团	59,700	810,129.00	0.01
518	301177	迪阿股份	29,200	805,044.00	0.01
519	301355	南王科技	82,300	804,894.00	0.01
520	301589	诺瓦星云	5,400	804,492.00	0.01
521	688326	经纬恒润	11,290	800,235.20	0.01
522	301029	怡合达	29,600	799,496.00	0.01
523	603275	众辰科技	21,000	799,470.00	0.01
524	002438	江苏神通	53,500	798,755.00	0.01
525	688235	百济神州	3,133	797,693.13	0.01
526	002768	国恩股份	15,300	796,518.00	0.01
527	688523	航天环宇	15,193	796,113.20	0.01
528	688522	纳睿雷达	39,759	795,975.18	0.01
529	603868	飞科电器	25,800	794,640.00	0.01
530	688395	正弦电气	35,942	794,318.20	0.01
531	001387	雪祺电气	62,200	794,294.00	0.01
532	301223	中荣股份	49,200	793,104.00	0.01
533	600230	沧州大化	60,900	792,918.00	0.01
534	301068	大地海洋	33,300	792,540.00	0.01
535	688191	智洋创新	22,192	792,254.40	0.01
536	301356	天振股份	30,100	790,727.00	0.01
537	688683	莱尔科技	20,850	790,632.00	0.01
538	603681	永冠新材	34,600	790,610.00	0.01
539	002111	威海广泰	87,700	789,300.00	0.01
540	300278	华昌达	203,400	789,192.00	0.01
541	002644	佛慈制药	115,800	788,598.00	0.01

542	603072	天和磁材	20,100	787,920.00	0.01
543	603989	艾华集团	15,000	787,500.00	0.01
544	603776	永安行	37,700	786,799.00	0.01
545	600862	中航高科	43,600	786,108.00	0.01
546	605369	拱东医疗	44,800	785,792.00	0.01
547	000029	深深房 A	35,600	784,980.00	0.01
548	300910	瑞丰新材	27,910	782,596.40	0.01
549	605005	合兴股份	49,500	782,595.00	0.01
550	600331	宏达股份	71,200	782,488.00	0.01
551	600710	苏美达	81,800	782,008.00	0.01
552	688819	天能股份	35,213	781,728.60	0.01
553	688653	康希通信	44,978	781,717.64	0.01
554	603615	茶花股份	48,400	781,660.00	0.01
555	301503	智迪科技	28,400	781,284.00	0.01
556	002333	罗普斯金	167,600	781,016.00	0.01
557	300926	博俊科技	44,000	781,000.00	0.01
558	603218	日月股份	76,400	780,808.00	0.01
559	301222	浙江恒威	26,060	780,757.60	0.01
560	000581	威孚高科	45,800	779,516.00	0.01
561	605377	华旺科技	83,800	779,340.00	0.01
562	301498	乖宝宠物	19,200	779,328.00	0.01
563	002661	克明食品	112,200	777,546.00	0.01
564	603489	八方股份	27,800	777,288.00	0.01
565	688269	凯立新材	24,500	776,895.00	0.01
566	300928	华安鑫创	26,900	776,872.00	0.01
567	002746	仙坛股份	152,300	776,730.00	0.01
568	301170	锡南科技	36,100	776,511.00	0.01
569	001366	播恩集团	71,600	776,144.00	0.01
570	600295	鄂尔多斯	72,400	776,128.00	0.01
571	603136	天目湖	92,600	775,988.00	0.01
572	605266	健之佳	53,000	775,920.00	0.01
573	300532	今天国际	124,500	775,635.00	0.01
574	688029	南微医学	10,801	775,511.80	0.01
575	600808	马钢股份	310,200	775,500.00	0.01
576	601858	中国科传	44,800	775,488.00	0.01
577	603279	景津装备	64,600	775,200.00	0.01
578	603066	音飞储存	79,400	774,944.00	0.01
579	002440	闰土股份	75,600	774,900.00	0.01
579	600995	南网储能	63,000	774,900.00	0.01
580	301371	敷尔佳	29,800	774,800.00	0.01
581	600298	安琪酵母	21,400	774,680.00	0.01
582	688356	键凯科技	10,048	774,499.84	0.01
583	600120	浙江东方	180,100	774,430.00	0.01

584	300960	通业科技	49,800	774,390.00	0.01
585	300492	华图山鼎	22,538	774,180.30	0.01
586	002430	杭氧股份	25,000	774,000.00	0.01
587	603568	伟明环保	50,300	773,614.00	0.01
588	002145	钛能化学	164,200	773,382.00	0.01
589	603970	中农立华	80,300	773,289.00	0.01
590	002835	同为股份	67,400	773,078.00	0.01
591	000030	富奥股份	199,700	772,839.00	0.01
592	002419	天虹股份	182,700	772,821.00	0.01
593	603529	爱玛科技	39,600	772,596.00	0.01
594	000715	中兴商业	166,500	772,560.00	0.01
595	002543	万和电气	124,200	772,524.00	0.01
596	600742	富维股份	106,700	772,508.00	0.01
597	605555	德昌股份	61,800	772,500.00	0.01
598	603585	苏利股份	56,500	772,355.00	0.01
599	001209	洪兴股份	48,200	772,164.00	0.01
600	002481	双塔食品	203,700	772,023.00	0.01
601	605567	春雪食品	96,600	771,834.00	0.01
602	002090	金智科技	87,300	771,732.00	0.01
603	000862	银星能源	160,100	771,682.00	0.01
604	603590	康辰药业	26,600	771,666.00	0.01
605	002232	启明信息	56,900	771,564.00	0.01
606	002968	新大正	91,200	771,552.00	0.01
607	002701	奥瑞金	181,100	771,486.00	0.01
608	600971	恒源煤电	111,800	771,420.00	0.01
609	600318	新力金融	128,100	771,162.00	0.01
610	300864	南大环境	40,200	771,036.00	0.01
611	300307	慈星股份	104,600	770,902.00	0.01
612	000035	中国天楹	159,600	770,868.00	0.01
613	603081	大丰实业	89,100	770,715.00	0.01
614	600486	扬农化工	15,200	770,640.00	0.01
615	301006	迈拓股份	61,400	770,570.00	0.01
616	603648	畅联股份	89,800	770,484.00	0.01
617	603237	五芳斋	62,200	770,036.00	0.01
618	600081	东风科技	84,800	769,984.00	0.01
619	600271	航天信息	117,000	769,860.00	0.01
620	002790	瑞尔特	144,700	769,804.00	0.01
621	688219	会通股份	59,489	769,787.66	0.01
622	600597	光明乳业	126,800	769,676.00	0.01
623	301278	快可电子	27,100	769,640.00	0.01
624	601686	友发集团	159,300	769,419.00	0.01
625	002152	广电运通	82,000	769,160.00	0.01
626	603029	天鹅股份	54,700	769,082.00	0.01

627	601512	中新集团	98,600	769,080.00	0.01
628	300625	三雄极光	84,700	769,076.00	0.01
629	603341	龙旗科技	18,100	769,069.00	0.01
630	002508	老板电器	52,600	769,012.00	0.01
631	600894	广日股份	100,900	768,858.00	0.01
632	600273	嘉化能源	117,900	768,708.00	0.01
633	002557	洽洽食品	42,800	768,688.00	0.01
634	000411	英特集团	85,100	768,453.00	0.01
635	600292	电投水电	63,800	768,152.00	0.01
636	600925	苏能股份	191,500	767,915.00	0.01
637	301198	喜悦智行	57,300	767,820.00	0.01
638	002381	双箭股份	148,200	767,676.00	0.01
639	600864	哈投股份	147,900	767,601.00	0.01
640	600058	五矿发展	66,400	766,920.00	0.01
641	002603	以岭药业	51,100	766,500.00	0.01
642	301519	舜禹股份	70,600	766,010.00	0.01
643	601003	柳钢股份	227,300	766,001.00	0.01
644	300070	碧水源	240,100	765,919.00	0.01
645	600351	亚宝药业	133,200	765,900.00	0.01
646	301207	华兰疫苗	47,000	765,630.00	0.01
647	002423	中粮资本	93,000	765,390.00	0.01
648	000958	电投产融	135,700	765,348.00	0.01
648	600993	马应龙	35,400	765,348.00	0.01
649	603759	海天股份	111,200	765,056.00	0.01
650	688686	奥普特	4,543	764,995.77	0.01
651	002372	伟星新材	93,400	764,946.00	0.01
652	600380	健康元	81,200	764,904.00	0.01
653	001382	新亚电缆	48,900	764,796.00	0.01
654	603816	顾家家居	34,200	764,712.00	0.01
655	001338	永顺泰	91,100	764,329.00	0.01
656	603565	中谷物流	77,900	764,199.00	0.01
657	601368	绿城水务	186,800	764,012.00	0.01
658	002258	利尔化学	60,100	763,871.00	0.01
659	600528	中铁工业	115,900	763,781.00	0.01
660	600787	中储股份	182,700	763,686.00	0.01
661	600853	龙建股份	251,200	763,648.00	0.01
662	601811	新华文轩	69,800	763,612.00	0.01
663	601595	上海电影	46,000	763,600.00	0.01
664	601019	山东出版	119,300	763,520.00	0.01
665	600217	中再资环	270,700	763,374.00	0.01
666	301088	戎美股份	66,600	763,236.00	0.01
667	000650	仁和药业	149,900	762,991.00	0.01
668	603214	爱婴室	63,000	762,930.00	0.01

669	000937	冀中能源	191,660	762,806.80	0.01
670	000927	中国铁物	336,000	762,720.00	0.01
671	603014	威高血净	23,300	762,609.00	0.01
672	600097	开创国际	98,000	762,440.00	0.01
673	002016	世荣兆业	190,600	762,400.00	0.01
674	002670	国盛证券	69,300	762,300.00	0.01
675	002819	东方中科	34,100	762,135.00	0.01
676	603858	步长制药	52,200	762,120.00	0.01
677	601928	凤凰传媒	86,700	762,093.00	0.01
678	301116	益客食品	89,000	761,840.00	0.01
679	301370	国科恒泰	94,100	761,269.00	0.01
680	600917	重庆燃气	167,300	761,215.00	0.01
681	002391	长青股份	156,300	761,181.00	0.01
682	605296	神农集团	27,300	761,124.00	0.01
683	600195	中牧股份	129,000	761,100.00	0.01
684	301166	优宁维	29,500	760,805.00	0.01
685	003039	顺控发展	69,100	760,791.00	0.01
686	600704	物产中大	161,100	760,392.00	0.01
687	601089	福元医药	46,700	760,276.00	0.01
688	605337	李子园	92,700	760,140.00	0.01
689	601968	宝钢包装	193,900	760,088.00	0.01
690	605108	同庆楼	66,900	759,984.00	0.01
691	600285	羚锐制药	39,200	759,696.00	0.01
692	301103	何氏眼科	50,700	759,486.00	0.01
693	600814	杭州解百	124,400	758,840.00	0.01
694	600060	海信视像	27,200	758,064.00	0.01
695	605179	一鸣食品	60,300	757,971.00	0.01
696	000902	新洋丰	65,500	757,180.00	0.01
697	002019	亿帆医药	80,900	756,415.00	0.01
698	002732	燕塘乳业	61,000	756,400.00	0.01
699	000028	国药一致	39,990	756,210.90	0.01
700	601007	金陵饭店	123,700	755,807.00	0.01
701	605339	南侨食品	63,300	755,802.00	0.01
702	605507	国邦医药	51,060	755,688.00	0.01
703	000498	山东路桥	159,500	754,435.00	0.01
704	600050	中国联通	188,500	754,000.00	0.01
705	601139	深圳燃气	133,100	753,346.00	0.01
706	600639	浦东金桥	82,600	753,312.00	0.01
707	002267	陕天然气	115,100	752,754.00	0.01
708	001213	中铁特货	224,700	752,745.00	0.01
709	688349	三一重能	49,509	751,546.62	0.01
710	603167	渤海轮渡	87,500	749,875.00	0.01
711	603194	中力股份	20,500	749,480.00	0.01

712	000401	金隅冀东	224,200	748,828.00	0.01
713	600803	新奥股份	47,200	745,760.00	0.01
714	002065	东华软件	104,100	743,274.00	0.01
715	601607	上海医药	48,200	742,280.00	0.01
716	601107	四川成渝	151,100	737,368.00	0.01
717	002839	张家港行	189,000	737,100.00	0.01
718	600970	中材国际	103,300	736,529.00	0.01
719	600717	天津港	189,000	735,210.00	0.01
720	603233	大参林	48,700	731,961.00	0.01
721	600713	南京医药	146,000	730,000.00	0.01
722	601038	一拖股份	68,800	728,592.00	0.01
723	601860	紫金银行	82,800	200,376.00	0.00
724	002321	华英农业	92,600	154,642.00	0.00
725	603639	海利尔	13,800	136,896.00	0.00
726	002061	浙江交科	24,600	81,180.00	0.00
727	300970	华绿生物	30	548.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	893,873,709.62	17.18
2	300274	阳光电源	604,019,378.20	11.61
3	300408	三环集团	416,762,497.87	8.01
4	300750	宁德时代	410,000,566.48	7.88
5	002384	东山精密	409,038,661.08	7.86
6	300502	新易盛	372,810,475.20	7.16
7	002475	立讯精密	357,322,423.59	6.87
8	688256	寒武纪	351,423,178.60	6.75
9	300059	东方财富	331,069,703.90	6.36
10	000725	京东方 A	325,379,420.48	6.25
11	688008	澜起科技	286,296,257.49	5.50
12	603986	兆易创新	277,661,406.61	5.34
13	300014	亿纬锂能	276,888,339.24	5.32
14	601869	长飞光纤	276,299,396.94	5.31
15	300394	天孚通信	275,391,361.19	5.29
16	002466	天齐锂业	274,633,698.07	5.28
17	603993	洛阳钼业	270,509,348.00	5.20
18	301308	江波龙	267,384,819.52	5.14
19	601899	紫金矿业	263,970,719.14	5.07
20	002916	深南电路	244,054,107.24	4.69
21	600150	中国船舶	238,814,644.61	4.59
22	300857	协创数据	226,054,319.46	4.34

23	002463	沪电股份	224,024,138.57	4.31
24	002281	光迅科技	211,211,387.25	4.06
25	688498	源杰科技	209,930,845.54	4.03
26	001309	德明利	207,602,006.44	3.99
27	002460	赣锋锂业	193,167,755.02	3.71
28	688012	中微公司	190,287,387.65	3.66
29	600875	东方电气	187,915,982.60	3.61
30	601872	招商轮船	184,858,998.29	3.55
31	002008	大族激光	180,094,668.80	3.46
32	301396	宏景科技	178,528,829.88	3.43
33	601138	工业富联	173,463,093.50	3.33
34	300604	长川科技	172,658,395.36	3.32
35	300033	同花顺	163,509,497.12	3.14
36	688525	佰维存储	162,077,065.06	3.11
37	601288	农业银行	155,668,129.00	2.99
38	002371	北方华创	152,063,748.69	2.92
39	603799	华友钴业	147,131,279.65	2.83
40	600584	长电科技	145,568,392.27	2.80
41	600547	山东黄金	142,145,930.02	2.73
42	600362	江西铜业	141,684,085.25	2.72
43	603259	药明康德	140,862,114.40	2.71
44	600188	兖矿能源	139,260,653.60	2.68
45	000630	铜陵有色	138,144,076.80	2.65
46	600010	包钢股份	134,641,507.00	2.59
47	002709	天赐材料	133,222,722.99	2.56
48	605117	德业股份	128,636,445.65	2.47
49	600519	贵州茅台	125,520,985.65	2.41
50	002851	麦格米特	124,989,462.10	2.40
51	300751	迈为股份	122,166,240.48	2.35
52	000338	潍柴动力	121,457,376.60	2.33
53	601857	中国石油	121,163,587.72	2.33
54	600938	中国海油	119,310,969.00	2.29
55	600183	生益科技	118,724,858.00	2.28
56	601328	交通银行	112,959,574.00	2.17
57	600489	中金黄金	112,801,782.85	2.17
58	688521	芯原股份	110,144,930.19	2.12
59	600309	万华化学	109,079,547.73	2.10
60	688167	炬光科技	105,676,842.84	2.03
61	600026	中远海能	105,069,072.00	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	300308	中际旭创	757, 671, 535. 09	14. 56
2	300274	阳光电源	657, 602, 122. 14	12. 64
3	002384	东山精密	521, 042, 571. 32	10. 01
4	002475	立讯精密	448, 797, 935. 80	8. 63
5	603986	兆易创新	442, 709, 380. 97	8. 51
6	300750	宁德时代	438, 590, 523. 43	8. 43
7	301308	江波龙	424, 553, 880. 25	8. 16
8	300408	三环集团	418, 230, 619. 80	8. 04
9	300502	新易盛	384, 215, 862. 84	7. 38
10	002463	沪电股份	327, 058, 196. 11	6. 29
11	601869	长飞光纤	314, 434, 232. 06	6. 04
12	001309	德明利	307, 954, 065. 99	5. 92
13	300394	天孚通信	300, 381, 227. 82	5. 77
14	688008	澜起科技	300, 217, 011. 21	5. 77
15	002916	深南电路	297, 262, 722. 68	5. 71
16	601899	紫金矿业	262, 433, 499. 35	5. 04
17	002371	北方华创	257, 418, 319. 92	4. 95
18	688498	源杰科技	238, 732, 190. 38	4. 59
19	601138	工业富联	238, 588, 076. 32	4. 59
20	000338	潍柴动力	236, 424, 739. 96	4. 54
21	603993	洛阳钼业	223, 913, 729. 68	4. 30
22	601872	招商轮船	213, 609, 065. 06	4. 11
23	300857	协创数据	205, 324, 789. 82	3. 95
24	300059	东方财富	199, 818, 064. 44	3. 84
25	600875	东方电气	197, 893, 385. 22	3. 80
26	600183	生益科技	194, 767, 573. 31	3. 74
27	688012	中微公司	190, 483, 668. 41	3. 66
28	600010	宝钢股份	186, 891, 788. 60	3. 59
29	688525	佰维存储	178, 518, 101. 50	3. 43
30	002460	赣锋锂业	176, 886, 585. 78	3. 40
31	002709	天赐材料	167, 898, 306. 54	3. 23
32	002281	光迅科技	159, 022, 568. 38	3. 06
33	000725	京东方 A	158, 670, 725. 00	3. 05
34	300033	同花顺	158, 083, 732. 41	3. 04
35	688256	寒武纪	156, 801, 134. 25	3. 01
36	300014	亿纬锂能	153, 681, 759. 54	2. 95
37	600487	亨通光电	152, 348, 506. 08	2. 93
38	000792	盐湖股份	152, 307, 130. 51	2. 93
39	600519	贵州茅台	149, 655, 846. 82	2. 88
40	300604	长川科技	130, 221, 408. 47	2. 50
41	601012	隆基绿能	125, 975, 407. 98	2. 42
42	603799	华友钴业	125, 690, 905. 69	2. 42

43	300476	胜宏科技	120,968,489.09	2.32
44	603259	药明康德	120,540,331.64	2.32
45	002008	大族激光	117,713,982.06	2.26
46	300751	迈为股份	117,025,281.85	2.25
47	688167	炬光科技	115,321,292.86	2.22
48	600938	中国海油	114,230,816.03	2.20
49	688521	芯原股份	114,112,116.11	2.19
50	000063	中兴通讯	111,634,124.36	2.15
51	600547	山东黄金	110,489,299.82	2.12
52	688702	盛科通信	109,499,842.84	2.10
53	002028	思源电气	108,946,360.85	2.09
54	000651	格力电器	107,180,221.75	2.06
55	002466	天齐锂业	106,495,009.65	2.05
56	300442	润泽科技	105,924,698.97	2.04
57	301396	宏景科技	104,099,511.80	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,950,013,125.83
卖出股票收入（成交）总额	22,519,525,409.48

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,075,049.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,075,049.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（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（%）
国金量化多策略 A	36,557	41,445.17	1,024,533,053.61	67.62	490,578,145.67	32.38
国金量化多策略 C	128,742	26,061.49	1,750,506,625.31	52.17	1,604,701,965.97	47.83
合计	165,299	29,463.70	2,775,039,678.92	56.98	2,095,280,111.64	43.02

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	95.30

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金量化多策略 A	2,086,200.40	0.1377
	国金量化多策略 C	250,998.90	0.0075
	合计	2,337,199.30	0.0480

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
基金合同生效日 (2018 年 2 月 1 日) 基金份额总额	425,485,490.92	—
本报告期期初基金份额总额	1,084,187,098.69	2,611,074,185.34
本报告期基金总申购份额	912,195,379.60	3,168,322,760.63
减: 本报告期基金总赎回份额	481,271,279.01	2,424,188,354.69
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,515,111,199.28	3,355,208,591.28

注: 总申购份额含红利再投、转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内, 基金管理人无重大人事变动。

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内, 无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内, 本基金无投资策略的重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
华泰证券	2	24,087,261,777.68	51.83	10,740,647.07	53.32	-
中信证券（山东）	2	20,934,600,462.36	45.05	9,125,472.88	45.30	-
金融街证券	2	1,447,676,295.27	3.12	276,414.02	1.37	-

注：（一）选择标准

- 1. 具备相关业务资质，公司经营行为规范；
- 2. 财务状况良好，公司经营状况稳定；
- 3. 具备较强的交易服务能力，相关制度建设、人员配置、系统建设等满足基金进行证券交易的需要；
- 4. 具备较强的研究服务能力，相关制度建设、人员配置、研究能力、研究质量等可以保障较为专业、审慎的研究服务；
- 5. 具备较强的合规风控能力，合规风控管理体系机制较为健全；
- 6. 交易佣金费率标准符合要求。

（二）选择程序

- 1. 基金管理人根据上述标准选用符合条件的证券公司；
- 2. 基金管理人和被选用的证券公司签订协议。

10.7.2 基金租用或者通过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	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交总

		的比例 (%)		总额的 比例 (%)		额的比 例 (%)
华泰证券	-	-	5,713,013,000.00	54.63	-	-
中信证券 (山东)	-	-	4,744,753,000.00	45.37	-	-
金融街证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
2	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
3	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
4	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 22 日
5	《国金基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 10 日
6	《国金基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
7	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
8	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 17 日
9	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
10	《2025 年度国金基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 24 日
11	《关于限制国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 5 月 12 日
12	《国金基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 5 月 29 日

13	《国金基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 6 月 18 日
14	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 6 月 27 日
15	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 6 月 27 日
16	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

公司于 2026 年 6 月 27 日披露《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，本基金的业绩比较基准自 2026 年 7 月 27 日起变更为“沪深 300 指数收益率*85%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富(总值)指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。
--

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集注册的文件；
- 2、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支

付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日