

国金科创创业量化选股股票型证券投资基金

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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59

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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
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	63
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金科创创业量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	国金科创创业量化选股股票	
基金主代码	025658	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 16 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	660,426,729.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	国金科创创业量化选股股票 A	国金科创创业量化选股股票 C
下属分级基金的交 易代码	025658	025659
报告期末下属分级 基金的份额总额	228,856,664.95 份	431,570,064.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的投资方法，在严格控制投资组合风险的前提下，力争实现组合资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、衍生品投资策略、融资业务策略。股票投资策略部分，本基金将重点聚焦科创板、创业板的上市公司，从经济基本面、市场情绪等基础数据出发筛选中长周期符合预期的个股，构建股票投资组合。该选股模型不仅对上市公司的价值进行全面评估，同时充分考虑市场情绪等因素，为投资标的合理定价。 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	上证科创板综合指数收益率*45%+创业板综合指数收益率*45%+恒生科技指数收益率（按估值汇率折算）*5%+同期银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	虞志海	韩鑫普
	联系电话	010-88005852	0755-82943666
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95565
传真		010-88005666	0755-82960794

注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	100026	518000
法定代表人	邵海波	朱江涛

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告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)	
	国金科创创业量化选股股票 A	国金科创创业量化选股股票 C
本期已实现收益	59,036,951.60	107,089,503.64
本期利润	82,205,420.89	143,717,566.50
加权平均基金份 额本期利润	0.3948	0.3786
本期加权平均净 值利润率	34.72%	33.33%
本期基金份额净 值增长率	39.57%	39.23%
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	63,602,208.80	118,419,675.35
期末可供分配基 金份额利润	0.2779	0.2744
期末基金资产净 值	318,919,479.89	599,785,573.77

期末基金份额净值	1.3935	1.3898
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	39.35%	38.98%

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

国金科创创业量化选股股票 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	37.09%	2.06%	34.78%	1.91%	2.31%	0.15%
过去六个月	39.57%	1.95%	32.68%	1.80%	6.89%	0.15%
自基金合同生效起至今	39.35%	1.86%	36.36%	1.74%	2.99%	0.12%

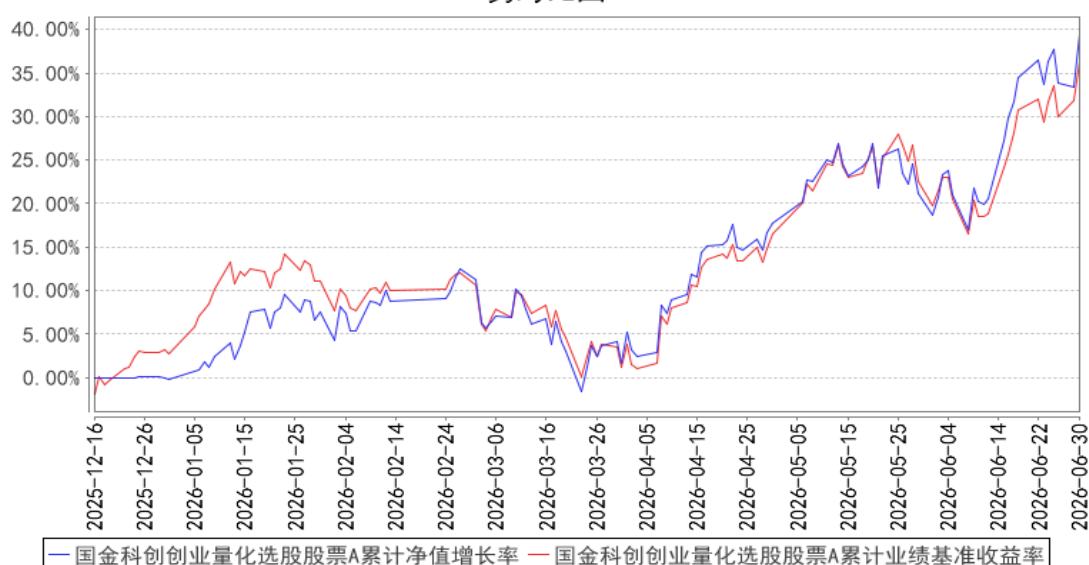
国金科创创业量化选股股票 C

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	36.93%	2.06%	34.78%	1.91%	2.15%	0.15%
过去六个月	39.23%	1.95%	32.68%	1.80%	6.55%	0.15%
自基金合同生效起至今	38.98%	1.86%	36.36%	1.74%	2.62%	0.12%

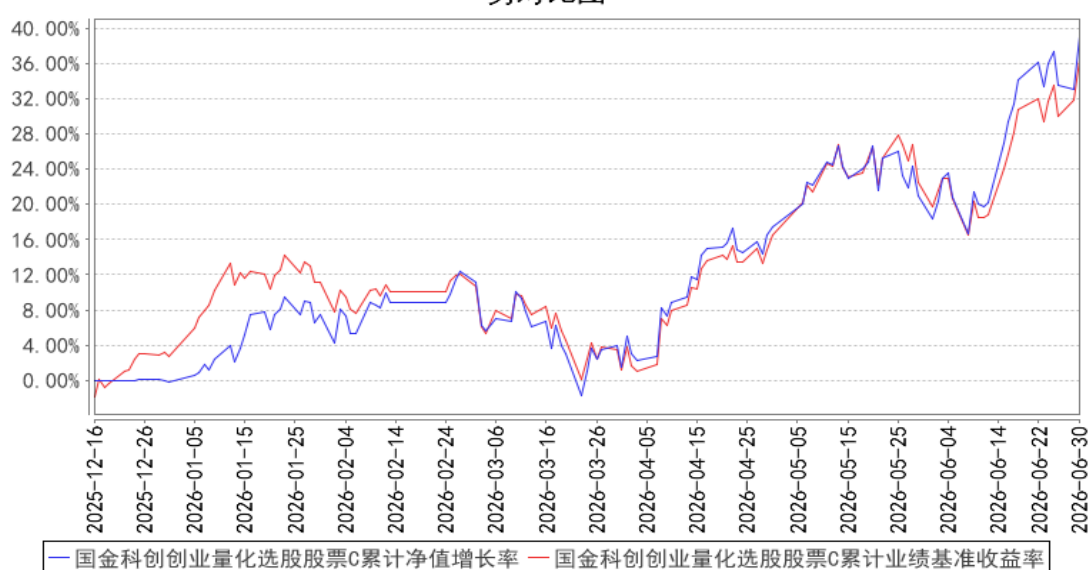
注：本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*45%+创业板综合指数收益率*45%+恒生科技指数收益率(按估值汇率折算)*5%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。

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

国金科创创业量化选股股票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



国金科创创业量化选股股票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 2025 年 12 月 16 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、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2025 年 12 月 16 日至 2026 年 6 月 15 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

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	2025年12月16	-	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

		日			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。
--	--	---	--	--	--

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。

4.2 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》和其他有关法律法规的规定，以及《国金科创创业量化选股股票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，市场环境相对较为极致，AI 主题叙事的影响成为超额收益波动的重要来源之一。整体而言，本基金的风险收益特征较为符合相应市场环境下的预期。

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 1.3935 元，累计单位净值为 1.3935 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 39.57%，同期业绩比较基准增长率为 32.68%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.3898 元，累计单位净值为 1.3898 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 39.23%，同期业绩比较基准增长率为 32.68%。

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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：国金科创创业量化选股股票型证券投资基金

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	108,127,772.91	456,396,725.11
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	840,213,088.96	155,603,987.69
其中：股票投资		840,213,088.96	155,603,987.69
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	-	-
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		13,178,286.10	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		961,519,147.97	612,000,712.80
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		41,538,670.82	-
应付管理人报酬		813,308.66	302,173.78
应付托管费		135,551.42	50,362.29
应付销售服务费		218,195.81	80,910.11
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	108,367.60	-
负债合计		42,814,094.31	433,446.18
净资产：			

实收基金	6. 4. 7. 10	660, 426, 729. 86	612, 600, 052. 69
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	258, 278, 323. 80	-1, 032, 786. 07
净资产合计		918, 705, 053. 66	611, 567, 266. 62
负债和净资产总计		961, 519, 147. 97	612, 000, 712. 80

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，国金科创创业量化选股股票 A 基金份额净值 1. 3935 元，基金份额总额 228, 856, 664. 95 份；国金科创创业量化选股股票 C 基金份额净值 1. 3898 元，基金份额总额 431, 570, 064. 91 份。国金科创创业量化选股股票份额总额合计为 660, 426, 729. 86 份。

6.2 利润表

会计主体：国金科创创业量化选股股票型证券投资基金

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
一、营业总收入		231, 712, 018. 18
1. 利息收入		224, 617. 77
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	213, 413. 69
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		11, 204. 08
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		170, 172, 751. 59
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	168, 499, 127. 67
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	1, 673, 623. 92
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	59, 796, 532. 15
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	1, 518, 116. 67
减：二、营业总支出		5, 789, 030. 79
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 969, 983. 87

其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	661, 663. 94
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	1, 068, 122. 83
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	89, 260. 15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		225, 922, 987. 39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		225, 922, 987. 39
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		225, 922, 987. 39

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 16 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国金科创创业量化选股股票型证券投资基金

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	612, 600, 052. 69	-	-1, 032, 786. 07	611, 567, 266. 62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	612, 600, 052. 69	-	-1, 032, 786. 07	611, 567, 266. 62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	47, 826, 677. 17	-	259, 311, 109. 87	307, 137, 787. 04
（一）、综合收益总额	-	-	225, 922, 987. 39	225, 922, 987. 39
（二）、本期基金份额交易产生	47, 826, 677. 17	-	33, 388, 122. 48	81, 214, 799. 65

的净资产变动数 （净资产减少以 “-”号填列）				
其中：1. 基金申 购款	689,365,071.65	-	144,118,337.98	833,483,409.63
2. 基金赎 回款	- 641,538,394.48	-	- 110,730,215.50	-752,268,609.98
（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	660,426,729.86	-	258,278,323.80	918,705,053.66

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 16 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金科创创业量化选股股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]2027 号文《关于准予国金科创创业量化选股股票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 2025 年 12 月 16 日正式生效，本基金首次设立募集规模为 612,600,052.69 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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含主板、科创板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、

政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、以及其他银行存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。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 80%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%），其中投资于科创板、创业板股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权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。如法律法规或监管机构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：上证科创板综合指数收益率*45%+创业板综合指数收益率*45%+恒生科技指数收益率（按估值汇率折算）*5%+同期银行活期存款利率（税后）*5%。

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 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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的有关过去事项、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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

无

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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。

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	55,626,665.15
等于：本金	55,614,521.44
加：应计利息	12,143.71
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	52,501,107.76
等于：本金	52,500,152.93
加：应计利息	954.83
减：坏账准备	-
合计	108,127,772.91

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		781,252,699.31	-	840,213,088.96	58,960,389.65
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		781,252,699.31	-	840,213,088.96	58,960,389.65

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

无

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	1,908.61
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	89,260.15
其他	17,198.84

合计	108,367.60
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金科创创业量化选股股票 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	218,914,791.67	218,914,791.67
本期申购	183,156,620.23	183,156,620.23
本期赎回（以“-”号填列）	-173,214,746.95	-173,214,746.95
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	228,856,664.95	228,856,664.95

国金科创创业量化选股股票 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	393,685,261.02	393,685,261.02
本期申购	506,208,451.42	506,208,451.42
本期赎回（以“-”号填列）	-468,323,647.53	-468,323,647.53
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	431,570,064.91	431,570,064.91

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

国金科创创业量化选股股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-41,362.32	-298,844.20	-340,206.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-41,362.32	-298,844.20	-340,206.52
本期利润	59,036,951.60	23,168,469.29	82,205,420.89
本期基金份额交易产	4,606,619.52	3,590,981.05	8,197,600.57

生的变动数			
其中：基金申购款	28,423,912.85	8,990,830.67	37,414,743.52
基金赎回款	-23,817,293.33	-5,399,849.62	-29,217,142.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,602,208.80	26,460,606.14	90,062,814.94

国金科创创业量化选股股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-155,281.25	-537,298.30	-692,579.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-155,281.25	-537,298.30	-692,579.55
本期利润	107,089,503.64	36,628,062.86	143,717,566.50
本期基金份额交易产生的变动数	11,485,452.96	13,705,068.95	25,190,521.91
其中：基金申购款	78,968,651.84	27,734,942.62	106,703,594.46
基金赎回款	-67,483,198.88	-14,029,873.67	-81,513,072.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	118,419,675.35	49,795,833.51	168,215,508.86

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	196,362.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,884.13
结算备付金利息收入	-
其他	4,167.51
合计	213,413.69

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	168,499,127.67
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	168,499,127.67

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	2,417,764,235.70
减：卖出股票成本总额	2,245,400,894.64
减：交易费用	3,864,213.39
买卖股票差价收入	168,499,127.67

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	1,673,623.92
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	1,673,623.92

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	59,796,532.15
股票投资	59,796,532.15
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	59,796,532.15

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	1,515,618.03
基金转换费收入	2,498.64
合计	1,518,116.67

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	89,260.15

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
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构、基金结算机构
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
招商证券股份有限公司	1,493,680,466.49	28.25

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
招商证券股份有限公司	13,470,000.00	50.00

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券股份有 限公司	644,320.90	27.82	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

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
当期发生的基金应支付的管理费	3,969,983.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,884,358.90
应支付基金管理人的净管理费	2,085,624.97

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首日起 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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
当期发生的基金应支付的托管费	661,663.94

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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		
	国金科创创业量化选股股票 A	国金科创创业量化选股股票 C	合计
国金基金管理有限公司	—	29,466.29	29,466.29
国金证券股份有限公司	—	5,362.12	5,362.12
招商证券股份有限公司	—	313,451.11	313,451.11
合计	—	348,279.52	348,279.52

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%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首日起 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司-活期存款	55,626,665.15	196,362.05
招商证券股份有限公司-其他存款	35,833,039.12	4,284.12

注：1. 本基金的其他存款为存放在开立于基金结算机构证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2. 除其他存款外，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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票流通受限	10.12	27.73	4,541	45,954.92	125,921.93	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300214	日科化学	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	10.25	2026 年 7 月 13 日	12.30	56,200	558,497.41	576,050.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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	108,127,772.91	-	-	-	-	-	108,127,772.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	840,213,088.96	840,213,088.96
应收申购款	-	-	-	-	-	13,178,286.10	13,178,286.10
资产总计	108,127,772.91	-	-	-	-	853,391,375.06	961,519,147.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	41,538,670.82	41,538,670.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	813,308.66	813,308.66
应付托管费	-	-	-	-	-	135,551.42	135,551.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	218,195.81	218,195.81
其他负债	-	-	-	-	-	108,367.60	108,367.60
负债总计	-	-	-	-	-	42,814,094.31	42,814,094.31
利率敏感度缺口	108,127,772.91	-	-	-	-	810,577,280.75	918,705,053.66

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	352,914,208.31	-	-	-	-	-	352,914,208.31
结算备付金	103,482,516.80	-	-	-	-	-	103,482,516.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	155,603,987.69	155,603,987.69
资产总计	456,396,725.11	-	-	-	-	155,603,987.69	612,000,712.80
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	302,173.78	302,173.78
应付托管费	-	-	-	-	-	50,362.29	50,362.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	80,910.11	80,910.11
负债总计	-	-	-	-	-	433,446.18	433,446.18
利率敏感度缺口	456,396,725.11	-	-	-	-	155,170,541.51	611,567,266.62

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	840,213,088.96	91.46	155,603,987.69	25.44
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	840,213,088.96	91.46	155,603,987.69	25.44

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	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。 Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和业绩比较基准数据回归得出，反映了基金和业绩比较基准的相关性。		
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%	46,677,560.61	382,300.07
	-5%	-46,677,560.61	-382,300.07

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	839, 414, 102. 34	155, 603, 987. 69
第二层次	576, 050. 00	—
第三层次	222, 936. 62	—
合计	840, 213, 088. 96	155, 603, 987. 69

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	840, 213, 088. 96	87. 38
	其中：股票	840, 213, 088. 96	87. 38
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	-	-
	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	108,127,772.91	11.25
8	其他各项资产	13,178,286.10	1.37
9	合计	961,519,147.97	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	846,364.00	0.09
B	采矿业	4,193,038.00	0.46
C	制造业	666,545,824.74	72.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,173,643.60	0.35
E	建筑业	1,641,635.58	0.18
F	批发和零售业	10,529,481.00	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	336,702.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,792,707.54	12.06
J	金融业	23,711,951.00	2.58
K	房地产业	926,938.00	0.10
L	租赁和商务服务业	2,683,386.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	9,173,471.00	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	4,053,364.50	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	251,664.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,352,918.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	840,213,088.96	91.46

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	688256	寒武纪	24,977	39,852,052.35	4.34
2	300308	中际旭创	27,100	34,417,000.00	3.75
3	688388	嘉元科技	476,020	20,944,880.00	2.28
4	301396	宏景科技	59,500	19,730,200.00	2.15
5	688469	芯联集成	1,849,952	19,627,990.72	2.14
6	300548	长芯博创	67,400	18,737,200.00	2.04
7	301511	德福科技	126,810	18,241,618.50	1.99
8	688195	腾景科技	90,729	17,472,590.82	1.90
9	688025	杰普特	35,731	16,793,570.00	1.83
10	300750	宁德时代	38,500	15,130,885.00	1.65
11	688627	精智达	20,892	14,937,780.00	1.63
12	688268	华特气体	53,560	14,327,300.00	1.56
13	301536	星辰科技	110,400	14,209,584.00	1.55
14	300769	德方纳米	196,500	13,067,250.00	1.42
15	688531	日联科技	73,077	12,996,013.68	1.41
16	688800	瑞可达	128,055	12,289,438.35	1.34
17	688536	思瑞浦	32,760	11,927,588.40	1.30
18	300803	指南针	129,500	11,871,265.00	1.29
19	301018	申菱环境	97,200	11,237,292.00	1.22
20	688390	固德威	97,554	10,585,584.54	1.15
21	300870	欧陆通	30,500	10,543,545.00	1.15
22	688301	奕瑞科技	76,143	9,441,732.00	1.03
23	688003	天准科技	72,708	9,255,728.40	1.01
24	300014	亿纬锂能	141,300	9,188,739.00	1.00
25	688127	蓝特光学	90,816	8,863,641.60	0.96
26	688052	纳芯微	30,663	8,840,449.53	0.96
27	301205	联特科技	26,442	8,834,272.20	0.96
28	300033	同花顺	33,500	8,073,500.00	0.88
29	002975	博杰股份	54,000	7,668,000.00	0.83
30	300721	怡达股份	198,400	7,469,760.00	0.81
31	301086	鸿富瀚	34,720	7,266,201.60	0.79
32	688027	国盾量子	13,339	6,722,989.39	0.73
33	688409	富创精密	21,848	6,690,950.00	0.73
34	603259	药明康德	46,700	5,814,617.00	0.63
35	301099	雅创电子	57,100	5,453,050.00	0.59
36	300790	宇瞳光学	206,600	5,394,326.00	0.59
37	300489	光智科技	16,700	5,209,565.00	0.57
38	000725	京东方 A	593,400	5,150,712.00	0.56
39	688017	绿的谐波	12,313	5,145,110.18	0.56
40	688629	华丰科技	24,752	4,641,247.52	0.51
41	688556	高测股份	346,347	4,599,488.16	0.50
42	688516	奥特维	79,961	4,588,961.79	0.50
43	688535	华海诚科	23,079	4,315,773.00	0.47

44	600584	长电科技	41,000	4,245,550.00	0.46
45	301285	鸿日达	36,200	3,993,946.00	0.43
46	301603	乔锋智能	27,300	3,925,740.00	0.43
47	300782	卓胜微	33,600	3,681,888.00	0.40
48	688209	英集芯	126,526	3,679,376.08	0.40
49	301358	湖南裕能	45,500	3,452,085.00	0.38
50	301246	宏源药业	125,700	3,381,330.00	0.37
51	300438	鹏辉能源	38,600	3,198,010.00	0.35
52	688107	安路科技	69,240	3,157,344.00	0.34
53	688262	国芯科技	70,518	3,048,493.14	0.33
54	002008	大族激光	19,800	2,972,178.00	0.32
55	002600	领益智造	169,100	2,932,194.00	0.32
56	603538	美诺华	89,100	2,900,205.00	0.32
57	000408	藏格矿业	40,700	2,821,324.00	0.31
58	300590	移为通信	190,000	2,726,500.00	0.30
59	301321	翰博高新	59,800	2,640,170.00	0.29
60	688220	翱捷科技	21,030	2,614,449.60	0.28
61	300661	圣邦股份	18,000	2,582,640.00	0.28
62	300059	东方财富	125,100	2,549,538.00	0.28
63	600418	江淮汽车	98,200	2,536,506.00	0.28
64	301377	鼎泰高科	4,500	2,479,050.00	0.27
65	300861	美畅股份	94,700	2,385,493.00	0.26
66	002916	深南电路	5,200	2,381,080.00	0.26
67	300765	石药创新	87,200	2,374,456.00	0.26
68	300986	志特新材	138,300	2,371,845.00	0.26
69	000792	盐湖股份	77,900	2,351,801.00	0.26
70	301550	斯菱智驱	24,990	2,284,835.70	0.25
71	301128	强瑞技术	14,500	2,260,550.00	0.25
72	300724	捷佳伟创	31,800	2,245,080.00	0.24
73	300602	飞荣达	42,900	2,196,480.00	0.24
74	300775	三角防务	96,400	2,124,656.00	0.23
75	688182	灿勤科技	49,246	2,121,025.22	0.23
76	688173	希荻微	110,199	2,109,208.86	0.23
77	688582	芯动联科	31,710	2,061,150.00	0.22
78	600547	山东黄金	86,600	1,999,594.00	0.22
79	688633	星球石墨	66,548	1,978,472.04	0.22
80	301251	威尔高	36,900	1,966,032.00	0.21
81	300766	每日互动	91,100	1,949,540.00	0.21
82	688609	九联科技	174,121	1,917,072.21	0.21
83	688155	先惠技术	23,204	1,876,971.56	0.20
84	300890	翔丰华	56,400	1,870,788.00	0.20
85	300745	欣锐科技	44,200	1,866,124.00	0.20
86	688045	必易微	23,008	1,858,586.24	0.20

87	600362	江西铜业	42,400	1,835,920.00	0.20
88	688510	航亚科技	76,184	1,819,273.92	0.20
89	688677	海泰新光	17,918	1,812,047.34	0.20
90	301196	唯科科技	14,230	1,784,726.60	0.19
91	300842	帝科股份	20,000	1,783,400.00	0.19
92	301031	中熔电气	14,292	1,707,179.40	0.19
93	603806	福斯特	100,800	1,692,432.00	0.18
94	601699	潞安环能	117,900	1,683,612.00	0.18
95	688378	奥来德	27,131	1,682,122.00	0.18
96	605168	三人行	33,000	1,671,120.00	0.18
97	688068	热景生物	19,214	1,663,932.40	0.18
98	300576	容大感光	31,600	1,618,552.00	0.18
99	300976	达瑞电子	20,160	1,605,744.00	0.17
100	300475	香农芯创	5,300	1,590,000.00	0.17
101	688063	派能科技	29,088	1,549,517.76	0.17
102	688228	开普云	19,947	1,542,700.98	0.17
103	688419	耐科装备	19,520	1,535,248.00	0.17
104	002865	钧达股份	25,500	1,521,840.00	0.17
105	688231	隆达股份	41,321	1,517,720.33	0.17
106	688331	荣昌生物	11,121	1,448,621.46	0.16
107	600893	航发动力	35,300	1,353,402.00	0.15
108	300780	德恩精工	39,700	1,352,182.00	0.15
109	603061	金海通	2,685	1,348,460.70	0.15
110	300502	新易盛	2,200	1,335,400.00	0.15
111	300491	通合科技	34,800	1,329,012.00	0.14
112	301366	一博科技	21,500	1,315,155.00	0.14
113	688667	菱电电控	9,720	1,299,078.00	0.14
114	688059	华锐精密	6,416	1,281,339.36	0.14
115	688226	威腾电气	29,848	1,278,389.84	0.14
116	300681	英搏尔	44,300	1,267,866.00	0.14
117	300613	富瀚微	15,400	1,233,232.00	0.13
118	301280	珠城科技	24,300	1,228,851.00	0.13
119	605162	新中港	158,600	1,222,806.00	0.13
120	688279	峰昭科技	5,446	1,222,300.24	0.13
121	300658	延江股份	103,800	1,186,434.00	0.13
122	688615	合合信息	10,488	1,186,192.80	0.13
123	688311	盟升电子	45,240	1,184,835.60	0.13
124	300843	胜蓝股份	7,400	1,156,250.00	0.13
125	688239	航宇科技	19,062	1,140,479.46	0.12
126	301072	中捷精工	27,400	1,123,674.00	0.12
127	688484	南芯科技	19,822	1,119,744.78	0.12
128	603115	海星股份	9,100	1,114,477.00	0.12
129	688309	恒誉环保	18,291	1,113,556.08	0.12

130	603124	江南新材	5,900	1,103,182.00	0.12
131	300943	春晖智控	24,500	1,101,275.00	0.12
132	300102	乾照光电	42,200	1,098,888.00	0.12
133	301529	福赛科技	11,200	1,079,232.00	0.12
134	301123	奕东电子	8,896	1,073,925.12	0.12
135	300939	秋田微	15,400	1,065,680.00	0.12
136	688062	迈威生物	36,876	1,041,747.00	0.11
137	301051	信濠光电	53,440	1,036,736.00	0.11
138	301568	思泰克	9,200	1,026,720.00	0.11
139	688255	凯尔达	36,887	1,025,458.60	0.11
140	300921	南凌科技	50,300	1,021,593.00	0.11
141	688291	金橙子	17,440	1,019,891.20	0.11
142	688456	有研粉材	7,303	1,019,498.80	0.11
143	301322	绿通科技	19,100	1,018,985.00	0.11
144	688678	福立旺	40,945	989,640.65	0.11
145	688786	悦安新材	21,329	982,840.32	0.11
146	688628	优利德	9,664	956,156.16	0.10
147	301041	金百泽	28,300	955,125.00	0.10
148	300905	宝丽迪	18,700	946,220.00	0.10
149	301631	壹连科技	13,080	939,928.80	0.10
150	300067	安诺其	173,400	939,828.00	0.10
151	301055	张小泉	22,100	938,587.00	0.10
152	301252	同星科技	23,100	936,243.00	0.10
153	688512	慧智微	58,477	933,877.69	0.10
154	300054	鼎龙股份	8,800	932,536.00	0.10
155	688166	博瑞医药	26,619	931,931.19	0.10
156	300539	横河精密	45,600	928,872.00	0.10
157	001339	智微智能	9,070	927,679.60	0.10
158	600549	厦门钨业	10,600	903,120.00	0.10
159	688599	天合光能	63,070	890,548.40	0.10
160	300819	聚杰微纤	11,800	873,436.00	0.10
161	688326	经纬恒润	12,207	865,232.16	0.09
162	300840	酷特智能	41,700	860,271.00	0.09
163	688061	灿瑞科技	17,150	851,840.50	0.09
164	601789	宁波建工	211,900	849,719.00	0.09
165	300106	西部牧业	86,200	848,208.00	0.09
166	688679	通源环境	20,144	847,860.96	0.09
167	300970	华绿生物	46,300	846,364.00	0.09
168	603178	圣龙股份	61,100	846,235.00	0.09
169	300504	天邑股份	52,400	845,212.00	0.09
170	300331	苏大维格	11,800	839,098.00	0.09
171	688636	智明达	23,013	833,760.99	0.09
172	600027	华电国际	186,600	830,370.00	0.09

173	300323	华灿光电	40,100	818,040.00	0.09
174	688779	五矿新能	98,933	802,346.63	0.09
175	688709	成都华微	20,791	791,929.19	0.09
176	002830	名雕股份	45,802	791,916.58	0.09
177	688350	富淼科技	22,791	786,973.23	0.09
178	300624	万兴科技	15,000	778,050.00	0.08
179	300481	濮阳惠成	40,600	772,212.00	0.08
180	688513	苑东生物	17,357	763,013.72	0.08
181	300909	汇创达	13,100	762,682.00	0.08
182	002957	科瑞技术	13,900	762,276.00	0.08
183	300390	天华新能	8,100	757,431.00	0.08
184	603305	旭升集团	62,300	755,076.00	0.08
185	605111	新洁能	7,600	753,464.00	0.08
186	605588	冠石科技	11,200	752,304.00	0.08
187	300358	楚天科技	93,800	750,400.00	0.08
188	600816	建元信托	305,700	745,908.00	0.08
189	688156	路德科技	24,583	743,635.75	0.08
190	688660	电气风电	86,122	742,371.64	0.08
191	688153	唯捷创芯	22,883	735,001.96	0.08
192	301328	维峰电子	10,000	712,000.00	0.08
193	301502	华阳智能	10,000	695,200.00	0.08
194	688379	华光新材	8,217	690,474.51	0.08
195	688558	国盛智科	20,956	688,614.16	0.07
196	301329	信音电子	27,900	677,691.00	0.07
197	300229	拓尔思	49,000	677,180.00	0.07
198	688216	气派科技	16,003	672,286.03	0.07
199	300596	利安隆	12,800	671,744.00	0.07
200	300269	联建光电	121,100	667,261.00	0.07
201	603937	丽岛新材	47,300	663,146.00	0.07
202	301180	万祥科技	52,400	656,572.00	0.07
203	300277	汽轮科技	43,200	649,728.00	0.07
204	300227	光韵达	53,200	633,080.00	0.07
205	300263	隆华科技	38,600	629,180.00	0.07
206	301067	显盈科技	16,600	627,812.00	0.07
207	301127	武汉天源	29,800	617,456.00	0.07
208	688020	方邦股份	2,405	600,288.00	0.07
209	688257	新锐股份	5,874	598,560.60	0.07
210	688199	久日新材	17,249	595,607.97	0.06
211	688280	精进电动	108,419	595,220.31	0.06
212	301136	招标股份	54,200	595,116.00	0.06
213	301198	喜悦智行	44,400	594,960.00	0.06
214	301052	果麦文化	26,700	593,274.00	0.06
215	300691	联合光电	37,400	591,294.00	0.06

216	688292	浩瀚深度	31,775	591,015.00	0.06
217	688758	赛分科技	26,625	586,016.25	0.06
218	301256	华融化学	45,100	584,496.00	0.06
219	688523	航天环宇	11,150	584,260.00	0.06
220	688046	药康生物	23,970	580,074.00	0.06
221	300214	日科化学	56,200	576,050.00	0.06
222	688167	炬光科技	1,606	568,861.26	0.06
223	688728	格科微	26,981	567,680.24	0.06
224	688568	中科星图	13,570	562,747.90	0.06
225	301248	杰创智能	6,600	553,938.00	0.06
226	688480	赛恩斯	6,271	549,276.89	0.06
227	301210	金杨精密	17,520	525,600.00	0.06
228	300195	长荣股份	88,500	519,495.00	0.06
229	301499	维科精密	17,600	513,568.00	0.06
230	688008	澜起科技	1,656	513,194.40	0.06
231	688069	德林海	13,681	511,122.16	0.06
232	688718	唯赛勃	31,992	510,912.24	0.06
233	688030	山石网科	32,295	509,938.05	0.06
234	000758	中色股份	77,600	509,832.00	0.06
235	300713	英可瑞	40,000	509,600.00	0.06
236	688077	大地熊	19,224	509,243.76	0.06
237	300516	久之洋	15,540	509,090.40	0.06
238	300823	建科智能	34,900	508,842.00	0.06
239	002188	中天服务	103,600	507,640.00	0.06
240	688653	康希通信	29,160	506,800.80	0.06
241	603171	税友股份	12,700	506,095.00	0.06
242	688320	禾川科技	12,206	505,938.70	0.06
243	300381	溢多利	90,000	505,800.00	0.06
244	600250	南京商旅	65,600	505,776.00	0.06
245	300965	恒宇信通	11,900	504,084.00	0.05
246	688196	卓越新能	13,982	501,953.80	0.05
247	603757	大元泵业	6,600	500,016.00	0.05
248	300928	华安鑫创	17,100	493,848.00	0.05
249	300365	恒华科技	107,600	492,808.00	0.05
250	300659	中孚信息	51,000	484,500.00	0.05
251	688600	皖仪科技	14,349	477,534.72	0.05
252	688768	容知日新	8,578	442,110.12	0.05
253	688588	凌志软件	48,240	438,501.60	0.05
254	688571	杭华股份	49,982	437,342.50	0.05
255	601869	长飞光纤	800	436,720.00	0.05
256	688591	泰凌微	12,701	436,660.38	0.05
257	300838	浙江力诺	32,500	433,875.00	0.05
258	300640	德艺文创	76,400	430,132.00	0.05

259	301177	迪阿股份	15,500	427,335.00	0.05
260	688101	三达膜	25,800	426,474.00	0.05
260	688119	中钢洛耐	89,784	426,474.00	0.05
261	688659	元琛科技	40,816	426,119.04	0.05
262	301337	亚华电子	15,300	425,340.00	0.05
263	300583	赛托生物	37,800	424,494.00	0.05
264	688358	祥生医疗	13,869	423,975.33	0.05
265	300682	朗新科技	42,800	423,720.00	0.05
266	300213	佳讯飞鸿	69,900	423,594.00	0.05
267	300968	格林精密	43,900	423,196.00	0.05
268	301512	智信精密	9,400	423,000.00	0.05
269	300916	朗特智能	18,100	422,997.00	0.05
270	300805	电声股份	58,300	422,675.00	0.05
271	301066	万事利	36,400	422,604.00	0.05
272	301567	贝隆精密	12,200	422,242.00	0.05
273	301025	读客文化	54,400	422,144.00	0.05
274	301159	三维天地	14,500	421,950.00	0.05
275	301516	中远通	29,800	421,670.00	0.05
276	300941	创识科技	30,700	421,511.00	0.05
277	603052	可川科技	5,200	421,148.00	0.05
278	300898	熊猫乳品	23,200	420,384.00	0.05
279	300645	正元智慧	35,700	420,189.00	0.05
280	300997	欢乐家	30,800	417,340.00	0.05
281	002110	三钢闽光	143,000	411,840.00	0.04
282	300535	达威股份	30,000	408,900.00	0.04
283	000301	东方盛虹	35,600	407,620.00	0.04
284	301060	兰卫医学	49,600	405,232.00	0.04
285	301116	益客食品	46,100	394,616.00	0.04
286	688737	中自科技	20,604	394,360.56	0.04
287	688382	益方生物	21,618	389,124.00	0.04
288	001399	惠科股份	11,352	385,965.91	0.04
289	688778	厦钨新能	6,957	378,460.80	0.04
290	300694	蠡湖股份	39,400	378,240.00	0.04
291	688345	博力威	6,415	372,583.20	0.04
292	301006	迈拓股份	29,600	371,480.00	0.04
293	301362	民爆光电	2,000	367,840.00	0.04
294	002921	联诚精密	13,194	360,723.96	0.04
295	603950	长源东谷	4,100	346,163.00	0.04
296	300667	必创科技	20,200	344,410.00	0.04
297	301135	瑞德智能	20,720	341,258.40	0.04
298	300902	国安达	20,800	340,912.00	0.04
299	300923	研奥股份	15,300	340,884.00	0.04
300	002566	益盛药业	56,400	340,656.00	0.04

301	301097	天益医疗	9,542	340,649.40	0.04
302	688539	高华科技	10,684	340,605.92	0.04
303	301355	南王科技	34,800	340,344.00	0.04
304	300886	华业香料	17,100	340,290.00	0.04
305	301515	港通医疗	19,400	340,082.00	0.04
306	600222	太龙药业	46,800	339,768.00	0.04
307	301156	美农生物	31,250	339,687.50	0.04
308	688618	三旺通信	11,039	339,670.03	0.04
309	300427	红相股份	50,600	339,526.00	0.04
310	301167	建研设计	27,400	339,486.00	0.04
311	688458	美芯晟	8,129	339,467.04	0.04
312	301272	英华特	10,300	339,282.00	0.04
313	000619	海螺新材	77,100	339,240.00	0.04
314	301469	恒达新材	12,300	339,234.00	0.04
315	300615	欣天科技	33,800	339,014.00	0.04
316	300675	建科院	28,600	338,910.00	0.04
317	301126	达嘉维康	39,600	338,580.00	0.04
318	301117	佳缘科技	14,500	338,575.00	0.04
319	300929	华骐环保	32,100	338,334.00	0.04
320	300416	苏试试验	16,600	338,308.00	0.04
321	688283	坤恒顺维	10,216	338,251.76	0.04
322	688203	海正生材	33,882	338,142.36	0.04
323	300126	锐奇股份	58,500	338,130.00	0.04
324	301266	宇邦新材	14,800	338,032.00	0.04
325	300945	曼卡龙	31,200	337,896.00	0.04
326	301032	新柴股份	36,300	337,590.00	0.04
327	300183	东软载波	32,300	337,535.00	0.04
328	603999	读者传媒	67,500	337,500.00	0.04
329	600697	欧亚集团	34,700	337,284.00	0.04
330	301106	骏成科技	16,260	337,232.40	0.04
331	688697	纽威数控	24,797	336,991.23	0.04
332	300753	爱朋医疗	17,800	336,954.00	0.04
333	300371	汇中股份	34,400	336,432.00	0.04
334	300930	屹通新材	11,800	336,300.00	0.04
335	300796	贝斯美	51,200	322,048.00	0.04
336	688610	埃科光电	1,212	319,240.80	0.03
337	601077	渝农商行	51,600	315,276.00	0.03
338	300187	永清环保	60,100	303,505.00	0.03
339	300610	晨化股份	30,200	294,450.00	0.03
340	688275	万润新能	2,294	292,599.70	0.03
341	688355	明志科技	15,033	289,385.25	0.03
342	300951	博硕科技	5,400	272,700.00	0.03
343	300786	国林科技	10,800	270,756.00	0.03

344	301225	恒勃股份	3,400	267,886.00	0.03
345	688391	钜泉科技	7,408	265,724.96	0.03
346	301390	经纬股份	8,100	261,306.00	0.03
347	688210	统联精密	6,421	260,114.71	0.03
348	688211	中科微至	7,555	260,043.10	0.03
349	301212	联盛化学	11,100	259,185.00	0.03
350	301629	矽电股份	600	258,240.00	0.03
351	688553	汇宇制药	24,207	257,320.41	0.03
352	301068	大地海洋	10,800	257,040.00	0.03
353	300538	同益股份	15,400	257,026.00	0.03
354	688157	松井股份	9,731	256,801.09	0.03
355	300862	蓝盾光电	12,300	256,332.00	0.03
356	001366	播恩集团	23,600	255,824.00	0.03
357	301500	飞南资源	9,800	255,290.00	0.03
358	688004	博汇科技	14,026	255,273.20	0.03
359	301192	泰祥股份	13,500	255,150.00	0.03
360	688638	誉辰智能	8,184	255,095.28	0.03
361	688658	悦康药业	19,820	254,885.20	0.03
362	003030	祖名股份	12,400	254,820.00	0.03
363	301199	迈赫股份	14,600	254,624.00	0.03
364	688067	爱威科技	12,628	254,454.20	0.03
365	688681	科汇股份	18,199	254,422.02	0.03
366	603836	海程邦达	32,200	254,380.00	0.03
367	301539	宏鑫科技	19,400	254,140.00	0.03
368	301010	晶雪节能	15,600	254,124.00	0.03
369	301300	远翔新材	8,100	254,097.00	0.03
370	600148	长春一东	17,500	253,925.00	0.03
371	301429	森泰股份	16,200	253,854.00	0.03
372	301170	锡南科技	11,800	253,818.00	0.03
373	002968	新大正	30,000	253,800.00	0.03
373	300810	中科海讯	10,000	253,800.00	0.03
374	300512	中亚股份	37,200	253,704.00	0.03
375	301535	浙江华远	18,900	253,638.00	0.03
376	300519	新光药业	21,400	253,590.00	0.03
377	300647	超频三	42,600	253,470.00	0.03
378	301298	东利机械	21,900	253,383.00	0.03
379	300625	三雄极光	27,900	253,332.00	0.03
380	688565	力源科技	26,795	253,212.75	0.03
381	300306	远方信息	26,100	253,170.00	0.03
382	301503	智迪科技	9,200	253,092.00	0.03
383	688579	地纬智能	33,338	253,035.42	0.03
384	301100	风光股份	18,200	252,980.00	0.03
385	000702	正虹科技	51,000	252,960.00	0.03

386	301083	百胜智能	19,200	252,864.00	0.03
387	301258	富士莱	11,100	252,747.00	0.03
388	300508	维宏股份	4,400	252,692.00	0.03
389	300025	华星创业	60,100	252,420.00	0.03
390	301065	本立科技	14,300	252,395.00	0.03
391	688589	力合微	10,981	252,343.38	0.03
392	301103	何氏眼科	16,800	251,664.00	0.03
393	301311	昆船智能	19,300	250,707.00	0.03
394	688141	杰华特	1,627	249,744.50	0.03
395	603700	宁水集团	21,200	246,132.00	0.03
396	688726	拉普拉斯	4,656	246,069.60	0.03
397	301369	联动科技	1,000	245,000.00	0.03
398	688113	联测科技	6,978	244,927.80	0.03
399	688420	美腾科技	11,607	244,559.49	0.03
400	301505	苏州规划	15,100	243,110.00	0.03
401	688639	华恒生物	15,024	242,487.36	0.03
402	603811	诚意药业	31,880	239,737.60	0.03
403	300966	共同药业	8,600	236,586.00	0.03
404	301166	优宁维	9,100	234,689.00	0.03
405	301121	紫建电子	7,200	230,544.00	0.03
406	688698	伟创电气	3,986	209,065.70	0.02
407	600851	海欣股份	19,500	175,695.00	0.02
408	301282	金禄电子	5,900	173,991.00	0.02
409	300434	金石亚药	15,300	171,819.00	0.02
410	688252	天德钰	7,152	171,648.00	0.02
411	605018	长华集团	11,500	171,465.00	0.02
412	603380	易德龙	3,800	171,342.00	0.02
413	688683	莱尔科技	4,516	171,246.72	0.02
414	603520	司太立	15,500	171,120.00	0.02
415	688060	云涌科技	5,197	170,929.33	0.02
416	688489	三未信安	7,529	170,908.30	0.02
417	301223	中荣股份	10,600	170,872.00	0.02
418	300789	唐源电气	9,600	170,592.00	0.02
419	688426	康为世纪	9,295	170,470.30	0.02
420	301320	豪江智能	13,200	170,280.00	0.02
421	688021	奥福科技	8,786	170,096.96	0.02
422	603759	海天股份	24,700	169,936.00	0.02
423	300032	金龙机电	44,700	169,860.00	0.02
424	603161	科华控股	12,800	169,856.00	0.02
425	688522	纳睿雷达	8,482	169,809.64	0.02
426	300956	英力股份	15,100	169,724.00	0.02
427	002999	天禾股份	31,900	169,708.00	0.02
428	300822	贝仕达克	14,500	169,650.00	0.02

429	301088	戎美股份	14,800	169,608.00	0.02
430	300906	日月明	6,800	169,524.00	0.02
431	600051	宁波联合	30,100	169,463.00	0.02
432	300543	朗科智能	23,500	169,435.00	0.02
433	300612	宣亚国际	15,500	169,415.00	0.02
434	605258	协和电子	5,000	169,400.00	0.02
435	300220	金运激光	16,300	169,357.00	0.02
436	301149	隆华新材	16,000	169,280.00	0.02
437	688013	天臣医疗	6,859	169,211.53	0.02
438	600126	杭钢股份	27,600	169,188.00	0.02
439	001210	金房能源	7,440	169,185.60	0.02
440	300851	交大思诺	7,600	169,100.00	0.02
441	603787	新日股份	18,600	169,074.00	0.02
442	688398	赛特新材	6,523	169,010.93	0.02
443	300833	浩洋股份	5,600	169,008.00	0.02
444	603900	莱绅通灵	30,000	168,900.00	0.02
445	301273	瑞晨环保	5,360	168,893.60	0.02
446	688383	新益昌	898	168,859.92	0.02
447	301601	惠通科技	10,800	168,696.00	0.02
448	603022	新通联	21,100	168,589.00	0.02
449	688595	芯海科技	3,842	168,510.12	0.02
450	301229	纽泰格	13,900	168,468.00	0.02
451	001277	速达股份	6,100	168,299.00	0.02
452	688084	晶品特装	3,346	168,236.88	0.02
453	688360	德马科技	9,396	168,188.40	0.02
454	301519	舜禹股份	15,500	168,175.00	0.02
455	603208	江山欧派	15,700	167,990.00	0.02
456	603569	长久物流	31,600	167,480.00	0.02
457	002637	赞宇科技	15,900	167,427.00	0.02
458	688651	盛邦安全	5,192	167,286.24	0.02
459	688686	奥普特	991	166,874.49	0.02
460	300150	世纪瑞尔	41,800	165,946.00	0.02
461	688288	鸿泉技术	9,213	163,715.01	0.02
462	688015	交控科技	10,617	163,289.46	0.02
463	603600	永艺股份	18,300	162,321.00	0.02
464	688395	正弦电气	7,309	161,528.90	0.02
465	301287	康力源	5,000	161,450.00	0.02
466	688285	高铁电气	22,514	161,425.38	0.02
467	601003	柳钢股份	47,900	161,423.00	0.02
468	600857	宁波中百	8,100	161,352.00	0.02
469	000683	博源化工	27,800	160,128.00	0.02
470	688517	金冠电气	9,147	159,889.56	0.02
471	688567	孚能科技	15,217	159,778.50	0.02

472	603079	圣达生物	14,000	158,480.00	0.02
473	002948	青岛银行	30,800	156,464.00	0.02
473	301418	协昌科技	2,800	156,464.00	0.02
474	688428	诺诚健华	5,493	156,385.71	0.02
475	300176	鸿特科技	31,900	154,715.00	0.02
476	688663	新风光	1,711	151,355.06	0.02
477	301151	冠龙节能	8,900	146,850.00	0.02
478	600713	南京医药	29,000	145,000.00	0.02
479	688175	高凌信息	3,962	99,644.30	0.01
480	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
481	301107	瑜欣电子	4,300	91,590.00	0.01
482	300988	津荣天宇	5,840	91,279.20	0.01
483	688486	龙迅股份	1,370	87,104.60	0.01
484	002845	同兴达	5,300	86,920.00	0.01
485	688357	建龙微纳	2,943	86,730.21	0.01
486	688682	霍莱沃	2,221	86,396.90	0.01
487	002296	辉煌科技	9,700	86,136.00	0.01
488	300399	天利科技	4,500	85,860.00	0.01
489	301227	森鹰窗业	3,400	85,714.00	0.01
490	688466	金科环境	6,678	85,678.74	0.01
491	688472	阿特斯	7,916	85,651.12	0.01
492	301391	卡莱特	1,500	85,650.00	0.01
493	300950	德固特	5,100	85,527.00	0.01
494	301234	五洲医疗	2,600	85,514.00	0.01
495	301063	海锅股份	5,100	85,476.00	0.01
496	600768	宁波富邦	5,700	85,386.00	0.01
497	605158	华达新材	13,300	85,120.00	0.01
498	300514	友讯达	9,100	85,085.00	0.01
499	000548	湖南投资	20,800	85,072.00	0.01
500	688176	亚虹医药	8,568	84,994.56	0.01
501	300987	川网传媒	6,900	84,870.00	0.01
502	300697	电工合金	5,600	84,840.00	0.01
503	300418	昆仑万维	2,100	84,756.00	0.01
504	000576	甘化科工	12,900	84,753.00	0.01
505	605567	春雪食品	10,600	84,694.00	0.01
506	001278	一彬科技	5,500	84,590.00	0.01
507	600099	林海股份	10,600	84,588.00	0.01
508	000757	浩物股份	24,800	84,568.00	0.01
509	000605	渤海股份	15,800	84,530.00	0.01
510	605151	西上海	4,800	84,528.00	0.01
511	300141	和顺电气	9,000	84,510.00	0.01
512	605001	威奥股份	15,500	84,475.00	0.01
513	300405	科隆股份	16,300	84,434.00	0.01

514	301118	恒光股份	3,100	84,413.00	0.01
515	301353	普莱得	5,080	84,378.80	0.01
516	002442	龙星科技	17,100	84,303.00	0.01
517	600510	黑牡丹	11,300	84,298.00	0.01
518	001319	铭科精技	4,300	84,280.00	0.01
519	000990	诚志股份	10,300	84,254.00	0.01
520	000959	首钢股份	24,000	84,240.00	0.01
521	688586	江航装备	7,205	84,226.45	0.01
522	002826	易明医药	5,600	84,168.00	0.01
523	600561	江西长运	17,000	84,150.00	0.01
524	300605	恒锋信息	9,100	84,084.00	0.01
525	300468	四方精创	4,000	84,040.00	0.01
526	002010	传化智联	18,800	84,036.00	0.01
527	603768	常青股份	9,200	83,996.00	0.01
528	688162	巨一科技	3,551	83,945.64	0.01
529	688410	山外山	5,844	83,919.84	0.01
530	688310	迈得医疗	5,457	83,874.09	0.01
531	605118	力鼎光电	2,400	83,736.00	0.01
532	688118	普元信息	4,149	83,477.88	0.01
533	301193	家联科技	4,500	83,430.00	0.01
534	001326	联域股份	1,400	83,006.00	0.01
535	300550	和仁科技	6,200	82,646.00	0.01
536	688330	宏力达	2,442	82,612.86	0.01
537	002483	润邦股份	16,700	82,498.00	0.01
538	600075	新疆天业	20,400	82,416.00	0.01
539	688799	华纳药厂	1,835	82,336.45	0.01
540	301489	思泉新材	500	82,290.00	0.01
541	688616	西力科技	8,145	82,264.50	0.01
542	000915	华特达因	2,900	82,099.00	0.01
543	300637	扬帆新材	7,900	82,002.00	0.01
544	001228	永泰运	3,200	81,760.00	0.01
545	688577	浙海德曼	1,780	81,577.40	0.01
546	002016	世荣兆业	20,300	81,200.00	0.01
547	603367	辰欣药业	6,300	80,829.00	0.01
548	002942	新农股份	5,600	80,248.00	0.01
549	301336	趣睡科技	2,000	79,900.00	0.01
550	603182	嘉华股份	7,000	79,800.00	0.01
551	002758	浙农股份	10,100	79,790.00	0.01
552	600955	维远股份	5,400	79,488.00	0.01
553	000421	南京公用	16,000	79,360.00	0.01
554	300466	赛摩智能	11,200	78,848.00	0.01
555	301019	宁波色母	4,400	78,452.00	0.01
556	688501	青达环保	4,002	76,838.40	0.01

557	688569	铁科轨道	4,559	73,627.85	0.01
558	688562	航天软件	1,476	22,228.56	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	71,561,590.00	11.70
2	688256	寒武纪	54,617,817.22	8.93
3	688167	炬光科技	43,037,168.81	7.04
4	300274	阳光电源	41,819,121.66	6.84
5	300548	长芯博创	39,274,151.00	6.42
6	300750	宁德时代	39,214,331.00	6.41
7	300394	天孚通信	36,807,721.86	6.02
8	688627	精智达	35,538,287.21	5.81
9	688008	澜起科技	34,483,787.93	5.64
10	300502	新易盛	33,304,369.94	5.45
11	688525	佰维存储	32,202,617.35	5.27
12	301308	江波龙	31,871,680.60	5.21
13	688025	杰普特	30,454,912.23	4.98
14	688498	源杰科技	29,165,347.80	4.77
15	301205	联特科技	28,929,956.56	4.73
16	688268	华特气体	28,681,140.86	4.69
17	601869	长飞光纤	27,981,978.00	4.58
18	688388	嘉元科技	27,939,121.85	4.57
19	688195	腾景科技	27,295,084.79	4.46
20	300857	协创数据	27,181,378.17	4.44
21	300017	网宿科技	26,443,101.00	4.32
22	688012	中微公司	25,511,260.89	4.17
23	688387	信科移动	24,016,578.68	3.93
24	301396	宏景科技	23,281,478.60	3.81
25	301511	德福科技	23,242,087.75	3.80
26	300870	欧陆通	22,432,730.00	3.67
27	688331	荣昌生物	22,231,668.05	3.64
28	688800	瑞可达	21,947,743.05	3.59
29	300475	香农芯创	21,943,741.00	3.59
30	688531	日联科技	21,406,433.77	3.50
31	688536	思瑞浦	21,262,868.05	3.48
32	300438	鹏辉能源	21,143,159.00	3.46
33	688516	奥特维	20,679,054.56	3.38
34	300769	德方纳米	19,994,561.50	3.27
35	300751	迈为股份	19,941,560.00	3.26
36	688017	绿的谐波	19,695,450.95	3.22

37	688390	固德威	19,358,464.12	3.17
38	688521	芯原股份	19,332,027.95	3.16
39	301550	斯菱智驱	19,229,334.01	3.14
40	688127	蓝特光学	18,905,319.34	3.09
41	688270	ST 臻镭	18,442,054.66	3.02
42	688469	芯联集成	18,311,091.09	2.99
43	300620	光库科技	18,167,148.00	2.97
44	688502	茂莱光学	18,032,528.87	2.95
45	688385	复旦微电	17,377,604.38	2.84
46	688003	天准科技	16,540,576.35	2.70
47	301018	申菱环境	16,291,462.60	2.66
48	301232	飞沃科技	16,090,045.82	2.63
49	300454	深信服	16,064,986.00	2.63
50	300014	亿纬锂能	15,919,662.00	2.60
51	002008	大族激光	14,912,436.00	2.44
52	688702	盛科通信	14,577,460.36	2.38
53	688409	富创精密	14,522,979.39	2.37
54	300476	胜宏科技	14,351,022.00	2.35
55	001309	德明利	14,299,628.00	2.34
56	300624	万兴科技	14,248,336.00	2.33
57	301123	奕东电子	14,185,120.66	2.32
58	300842	帝科股份	13,939,293.00	2.28
59	688515	裕太微	13,693,109.34	2.24
60	688615	合合信息	13,516,411.05	2.21
61	300456	赛微电子	13,023,369.41	2.13
62	300803	指南针	12,959,651.00	2.12
63	300567	精测电子	12,742,181.00	2.08
64	300346	南大光电	12,662,685.00	2.07
65	301536	星辰科技	12,409,945.00	2.03
66	300806	斯迪克	12,356,759.00	2.02
67	300721	怡达股份	12,326,024.00	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(%)
1	300308	中际旭创	55,943,052.00	9.15
2	300394	天孚通信	50,732,895.43	8.30
3	688167	炬光科技	49,751,270.25	8.14
4	300274	阳光电源	46,495,841.34	7.60
5	301308	江波龙	41,873,423.60	6.85
6	688498	源杰科技	40,299,391.92	6.59
7	300502	新易盛	40,063,311.34	6.55

8	688008	澜起科技	38,237,730.64	6.25
9	688525	佰维存储	36,049,170.52	5.89
10	601869	长飞光纤	34,986,267.20	5.72
11	300857	协创数据	33,602,171.70	5.49
12	688627	精智达	31,538,004.52	5.16
13	301205	联特科技	30,930,713.00	5.06
14	300750	宁德时代	30,190,421.00	4.94
15	688268	华特气体	27,648,607.82	4.52
16	300548	长芯博创	26,797,192.24	4.38
17	688012	中微公司	26,575,018.79	4.35
18	688256	寒武纪	25,293,943.27	4.14
19	300475	香农芯创	24,814,187.56	4.06
20	300620	光库科技	24,556,130.00	4.02
21	688025	杰普特	24,451,466.76	4.00
22	300017	网宿科技	24,033,181.40	3.93
23	688387	信科移动	21,689,830.16	3.55
24	688331	荣昌生物	20,874,065.00	3.41
25	688521	芯原股份	20,280,511.60	3.32
26	688502	茂莱光学	18,928,965.06	3.10
27	300567	精测电子	18,126,399.46	2.96
28	688270	ST 臻镭	17,787,882.79	2.91
29	300751	迈为股份	17,636,969.89	2.88
30	300438	鹏辉能源	17,562,623.00	2.87
31	300058	蓝色光标	17,343,221.38	2.84
32	688385	复旦微电	17,047,494.92	2.79
33	301232	飞沃科技	16,886,392.80	2.76
34	688515	裕太微	16,622,406.33	2.72
35	603929	亚翔集成	16,530,082.00	2.70
36	688702	盛科通信	16,452,766.52	2.69
37	300870	欧陆通	16,199,789.06	2.65
38	688017	绿的谐波	16,128,379.22	2.64
39	300806	斯迪克	15,349,634.00	2.51
40	300476	胜宏科技	15,037,809.50	2.46
41	688409	富创精密	14,809,742.21	2.42
42	001309	德明利	14,793,014.00	2.42
43	688536	思瑞浦	14,594,800.38	2.39
44	301338	凯格精机	14,585,794.03	2.38
45	301550	斯菱智驱	14,495,260.07	2.37
46	688257	新锐股份	14,419,441.27	2.36
47	300604	长川科技	13,515,261.00	2.21
48	300624	万兴科技	13,344,488.24	2.18
49	300346	南大光电	13,089,047.72	2.14
50	688516	奥特维	13,016,475.65	2.13

51	300454	深信服	12,940,090.55	2.12
52	002008	大族激光	12,697,351.00	2.08
53	688531	日联科技	12,548,694.37	2.05
54	300456	赛微电子	12,429,841.32	2.03

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	2,870,213,463.76
卖出股票收入（成交）总额	2,417,764,235.70

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	13,178,286.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,178,286.10

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 (%)
国金科创 创业量化 选股股票 A	6,105	37,486.76	31,220,906.49	13.64	197,635,758.46	86.36
国金科创 创业量化	12,458	34,642.00	74,613,313.58	17.29	356,956,751.33	82.71

选股股票 C						
合计	18,563	35,577.59	105,834,220.07	16.03	554,592,509.79	83.97

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金科创创业量化选股股票 A	358,714.84	0.1567
	国金科创创业量化选股股票 C	303,719.13	0.0704
	合计	662,433.97	0.1003

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金科创创业量化选股股票 A	10~50
	国金科创创业量化选股股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国金科创创业量化选股股票 A	0
	国金科创创业量化选股股票 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金科创创业量化选股股票 A	国金科创创业量化选股股票 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 16 日）基金份额总额	218,914,791.67	393,685,261.02
本报告期期初基金份额总额	218,914,791.67	393,685,261.02
本报告期基金总申购份额	183,156,620.23	506,208,451.42
减：本报告期基金总赎回份额	173,214,746.95	468,323,647.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金	228,856,664.95	431,570,064.91

份额总额		
------	--	--

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。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

除上述人事调整以外，本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无其他重大人事变动。

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、公募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 (%)	
中信建投证券	3	3,794,090,111.53	71.75	1,672,027.33	72.18	-
招商证券	3	1,493,680,466.49	28.25	644,320.90	27.82	-

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 (%)
中信建投证券	-	-	13,470,000.00	50.00	-	-
招商证券	-	-	13,470,000.00	50.00	-	-

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	《国金科创创业量化选股股票型证券投资基金招募说明书(更新)》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
2	《国金科创创业量化选股股票型证券投资基金（国金科创创业量化选股股票 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	《国金科创创业量化选股股票型证券投资基金（国金科创创业量化选股股票 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
5	《关于国金科创创业量化选股股票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》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 3 月 12 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
8	《国金科创创业量化选股股票型证券投资基金 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
9	《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
10	《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
11	《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
12	《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
13	《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

无

§ 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、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金基金合同；
- 3、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金托管协议；
- 4、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 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