

国金智远量化选股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：浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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	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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69

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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§ 8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
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	72
10.8 其他重大事件	73
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	74
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金智远量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	国金智远量化选股混合	
基金主代码	025656	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 11 月 4 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	3,328,793,095.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	国金智远量化选股混合 A	国金智远量化选股混合 C
下属分级基金的交 易代码	025656	025657
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,160,577,888.25 份	2,168,215,207.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的稳健增值。
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、参与融资业务策略。 股票投资策略部分，结合国内外长期投资规律，基金管理人依据实战经验和机器学习技术搭建了量化选股模型。本基金的量化选股模型以股票市场的宏观环境、行业及个股特性为分析框架，分别对各类因子构建模型综合评价，包括但不限于个股超额、行业、价值、动量、成长、质量、分析师预期等各个维度。本基金采用机器学习模型对各个维度组合因子进行分析，进而对股票综合评价，构建投资组合。根据市场宏观环境、公司基本面、市场情绪等输入信息的变化，模型对输出结果动态调整，以一定程度上适应市场变化。 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	中证全指指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	虞志海	胡燕
	联系电话	010-88005852	0571-87659392
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	zsyhzctgb@czbank.com

客户服务电话	4000-2000-18	95527
传真	010-88005666	0571-88268688
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路1037号一层1049室	杭州市萧山区鸿宁路1788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	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码	100026	310006
法定代表人	邵海波	陈海强

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)	
	国金智远量化选股混合 A	国金智远量化选股混合 C
本期已实现收益	153,037,063.58	283,228,860.73
本期利润	132,316,270.67	253,075,631.10
加权平均基金份额 本期利润	0.2090	0.2162
本期加权平均净 值利润率	17.67%	18.41%
本期基金份额净 值增长率	24.65%	24.35%
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	298,594,544.88	548,958,092.66
期末可供分配基 金份额利润	0.2573	0.2532

期末基金资产净值	1,474,171,647.35	2,745,214,505.07
期末基金份额净值	1.2702	1.2661
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	27.02%	26.61%

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

国金智远量化选股混合 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	17.93%	1.67%	9.20%	1.13%	8.73%	0.54%
过去六个月	24.65%	1.56%	7.80%	1.10%	16.85%	0.46%
自基金合同生效起至今	27.02%	1.38%	8.04%	1.02%	18.98%	0.36%

国金智远量化选股混合 C

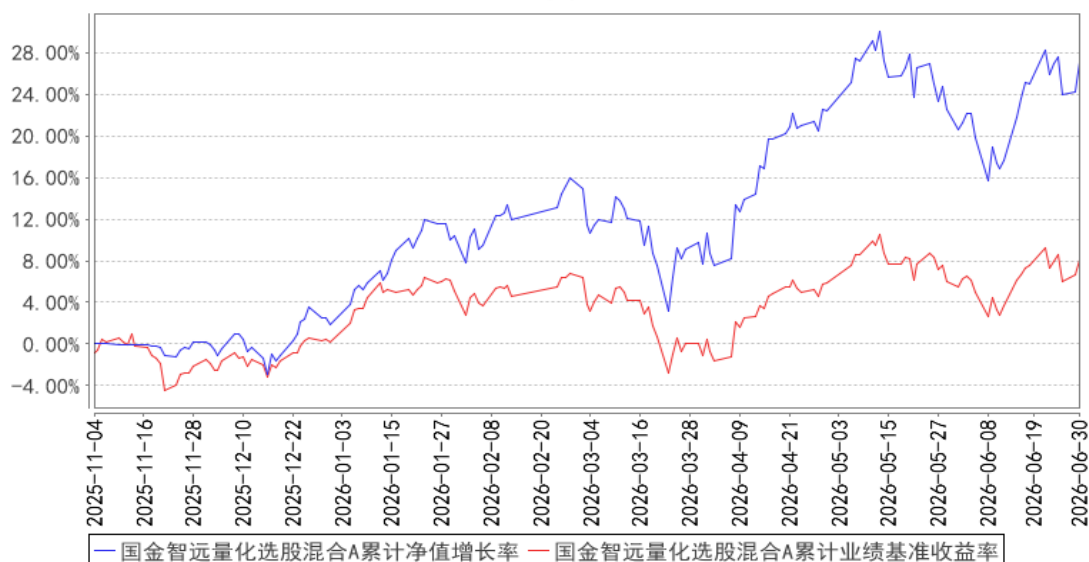
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	17.78%	1.67%	9.20%	1.13%	8.58%	0.54%
过去六个月	24.35%	1.56%	7.80%	1.10%	16.55%	0.46%
自基金合同生效起至今	26.61%	1.38%	8.04%	1.02%	18.57%	0.36%

注：本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率

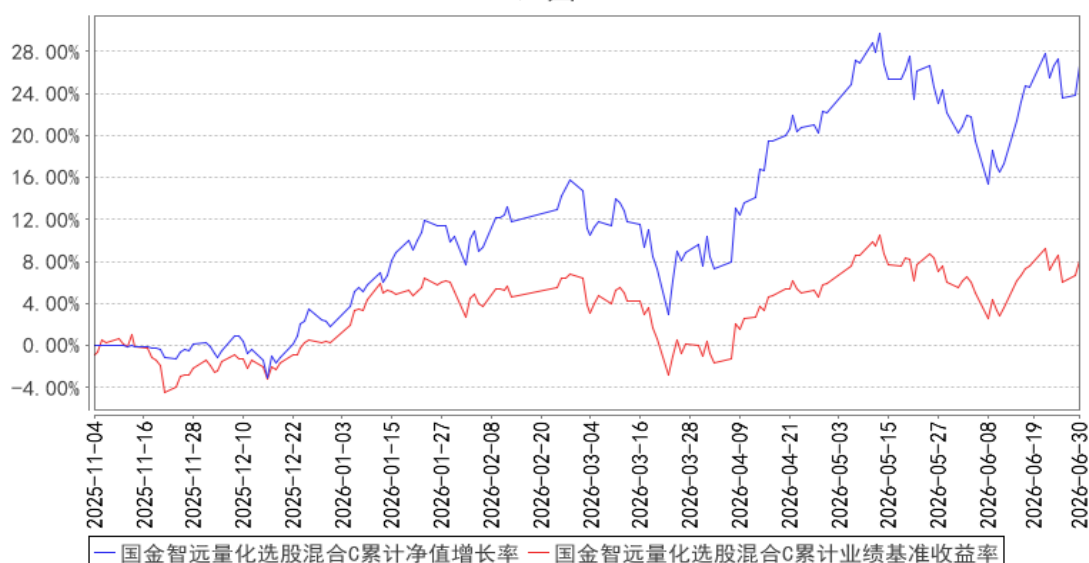
*5%+银行活期存款利率(税后)*15%。

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

国金智远量化选股混合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



国金智远量化选股混合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 11 月 4 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 11 月 4 日至 2026 年 5 月 3 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		
姚加红	本基金的基金经理	2025 年 11 月 4 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	-

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《国金智远量化选股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，本基金的超额收益和波动水平较为符合预期，主要得益于分散持仓下多个收益来源对超额均有正向贡献，以及较为严格的风险控制。

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 1.2702 元，累计单位净值为 1.2702 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 24.65%，同期业绩比较基准增长率为 7.80%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.2661 元，累计单位净值为 1.2661 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 24.35%，同期业绩比较基准增长率为 7.80%。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，本基金的管理人——国金基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国金基金管理有限公司编制和披露的国金智远量化选股混合型证券投资基金 2026 年中期报告中财务指标、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，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：国金智远量化选股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	324,036,601.69	131,463,291.68
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	3,860,655,692.49	1,355,708,533.61
其中：股票投资		3,860,655,692.49	1,355,708,533.61
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	65,877,000.00	—
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		22,403,683.62	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		4,272,972,977.80	1,487,171,825.29
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		47,944,373.31	—

应付管理人报酬		3,760,326.56	1,489,788.21
应付托管费		626,721.08	248,298.02
应付销售服务费		983,910.54	429,927.28
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	271,493.89	20,000.00
负债合计		53,586,825.38	2,188,013.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,328,793,095.70	1,458,069,699.36
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	890,593,056.72	26,914,112.42
净资产合计		4,219,386,152.42	1,484,983,811.78
负债和净资产总计		4,272,972,977.80	1,487,171,825.29

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，国金智远量化选股混合 A 基金份额净值 1.2702 元，基金份额总额 1,160,577,888.25 份；国金智远量化选股混合 C 基金份额净值 1.2661 元，基金份额总额 2,168,215,207.45 份。国金智远量化选股混合份额总额合计为 3,328,793,095.70 份。

6.2 利润表

会计主体：国金智远量化选股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
一、营业总收入		403,326,225.95
1. 利息收入		291,250.32
其中：存款利息收入	6.4.7.13	102,888.81
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		188,361.51
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		450,548,469.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	440,405,691.31
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	10,142,778.45

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	-50, 874, 022. 54
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	3, 360, 528. 41
减：二、营业总支出		17, 934, 324. 18
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	12, 422, 945. 89
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	2, 070, 491. 04
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	3, 349, 147. 40
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	91, 739. 85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		385, 391, 901. 77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		385, 391, 901. 77
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		385, 391, 901. 77

注：本基金合同生效日为 2025 年 11 月 4 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：国金智远量化选股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	1, 458, 069, 699. 36	-	26, 914, 112. 42	1, 484, 983, 811. 78
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,458,069,699.36	-	26,914,112.42	1,484,983,811.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,870,723,396.34	-	863,678,944.30	2,734,402,340.64
(一)、综合收益总额	-	-	385,391,901.77	385,391,901.77
(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)	1,870,723,396.34	-	478,287,042.53	2,349,010,438.87
其中：1. 基金申购款	3,658,125,705.17	-	792,265,038.08	4,450,390,743.25
2. 基金赎回款	-1,787,402,308.83	-	-313,977,995.55	-2,101,380,304.38
(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	3,328,793,095.70	-	890,593,056.72	4,219,386,152.42

注：本基金合同生效日为 2025 年 11 月 4 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：

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

国金智远量化选股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[2025]2028 号文《关于准予国金智远量化选股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 2025 年 11 月 4 日正式生效，本基金首次设立募集规模为 1,458,069,699.36 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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

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 60%-95%（投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%）。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：中证全指指数收益率×80%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×15%。

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	298,720,592.75
等于：本金	298,716,398.59
加：应计利息	4,194.16
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	25,316,008.94
等于：本金	25,315,693.68
加：应计利息	315.26
减：坏账准备	-
合计	324,036,601.69

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		3,905,085,277.17	-	3,860,655,692.49	-44,429,584.68
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		3,905,085,277.17	-	3,860,655,692.49	-44,429,584.68

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	65,877,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	65,877,000.00	-

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	4,942.49
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	91,739.85
其他	174,811.55
合计	271,493.89

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金智远量化选股混合 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	448,037,776.78	448,037,776.78
本期申购	1,174,072,881.25	1,174,072,881.25
本期赎回（以“-”号填列）	-461,532,769.78	-461,532,769.78
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	1,160,577,888.25	1,160,577,888.25

国金智远量化选股混合 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	1,010,031,922.58	1,010,031,922.58

本期申购	2,484,052,823.92	2,484,052,823.92
本期赎回(以“-”号填列)	-1,325,869,539.05	-1,325,869,539.05
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	2,168,215,207.45	2,168,215,207.45

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

国金智远量化选股混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,535,400.00	1,981,581.68	8,516,981.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,535,400.00	1,981,581.68	8,516,981.68
本期利润	153,037,063.58	-20,720,792.91	132,316,270.67
本期基金份额交易产生的变动数	139,022,081.30	33,738,425.45	172,760,506.75
其中：基金申购款	208,984,184.14	44,680,670.47	253,664,854.61
基金赎回款	-69,962,102.84	-10,942,245.02	-80,904,347.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	298,594,544.88	14,999,214.22	313,593,759.10

国金智远量化选股混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,934,274.56	4,462,856.18	18,397,130.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	13,934,274.56	4,462,856.18	18,397,130.74
本期利润	283,228,860.73	-30,153,229.63	253,075,631.10
本期基金份额交易产生的变动数	251,794,957.37	53,731,578.41	305,526,535.78
其中：基金申购款	453,193,511.52	85,406,671.95	538,600,183.47
基金赎回款	-201,398,554.15	-31,675,093.54	-233,073,647.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	548,958,092.66	28,041,204.96	576,999,297.62

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	29,003.10
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	9,951.35
结算备付金利息收入	—
其他	63,934.36
合计	102,888.81

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	440,405,691.31
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	440,405,691.31

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	8,025,245,812.72
减：卖出股票成本总额	7,571,569,361.28
减：交易费用	13,270,760.13
买卖股票差价收入	440,405,691.31

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	10,142,778.45
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	10,142,778.45

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	-50,874,022.54
股票投资	-50,874,022.54
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	-50,874,022.54

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	3,338,581.77
基金转换费收入	21,946.64
合计	3,360,528.41

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	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	91,739.85

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
浙商银行股份有限公司	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
当期发生的基金应支付的管理费	12,422,945.89
其中：应支付销售机构的客户维护	4,772,297.12

费	
应支付基金管理人的净管理费	7,650,648.77

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	2,070,491.04

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		
	国金智远量化选股混	国金智远量化选股混	合计

	合 A	合 C	
国金基金管理有限公司	-	383,880.47	383,880.47
国金证券股份有限公司	-	64,135.04	64,135.04
浙商银行股份有限公司	-	639,228.84	639,228.84
合计	-	1,087,244.35	1,087,244.35

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	国金智远量化选股混合 A	国金智远量化选股混合 C
基金合同生效日(2025 年 11 月 4 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	22,670,675.60	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	22,670,675.60	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.9534%	-

注：1. 基金管理人投资本基金的相关费用按基金招募说明书及相关公告的有关规定计算并支付。

2. 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。

6.4.10.5.2 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
浙商银行股份有限公司-活期存款	298,720,592.75	29,003.10

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

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 6 月 29	重大事项停牌	10.25	2026 年 7 月 13 日	12.30	276,900	2,735,726.00	2,838,225.00	-

		日								
603722	阿科力	2026年6月29日	重大事项停牌	39.60	2026年7月6日	43.56	49,100	1,905,809.20	1,944,360.00	-
603137	恒尚节能	2026年6月16日	重大事项停牌	12.94	2026年7月1日	14.23	28,400	386,579.99	367,496.00	-

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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	324,036,601.69	-	-	-	-	-	324,036,601.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-3,860,655,692.49	-3,860,655,692.49
买入返售金融资产	65,877,000.00	-	-	-	-	-	65,877,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	22,403,683.62	22,403,683.62
资产总计	389,913,601.69	-	-	-	-	-3,883,059,376.11	-3,883,059,376.11
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	47,944,373.31	47,944,373.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,760,326.56	3,760,326.56
应付托管费	-	-	-	-	-	626,721.08	626,721.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	983,910.54	983,910.54
其他负债	-	-	-	-	-	271,493.89	271,493.89
负债总计	-	-	-	-	-	53,586,825.38	53,586,825.38
利率敏感度缺口	389,913,601.69	-	-	-	-	-3,829,472,550.73	-3,829,472,550.73
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	131,463,291.68	-	-	-	-	-	131,463,291.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,355,708,533.61	-1,355,708,533.61
资产总计	131,463,291.68	-	-	-	-	-1,355,708,533.61	-1,355,708,533.61
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,489,788.21	1,489,788.21
应付托管费	-	-	-	-	-	248,298.02	248,298.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	429,927.28	429,927.28
其他负债	-	-	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,188,013.51	2,188,013.51
利率敏感度缺口	131,463,291.68	-	-	-	-	-1,353,520,520.10	-1,353,520,520.10

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	3,860,655,692.49	91.50	1,355,708,533.61	91.29
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	3,860,655,692.49	91.50	1,355,708,533.61	91.29

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证全指指数（000985.CSI）变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证全指指数数据回
----	---

	归得出，反映了基金和中证全指指数的相关性。		
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%	233,004,051.91	39,222,981.36
	-5%	-233,004,051.91	-39,222,981.36

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	3,855,505,611.49	1,355,708,533.61
第二层次	5,150,081.00	-
第三层次	-	-
合计	3,860,655,692.49	1,355,708,533.61

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	3,860,655,692.49	90.35
	其中：股票	3,860,655,692.49	90.35
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	65,877,000.00	1.54
	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	324,036,601.69	7.58
8	其他各项资产	22,403,683.62	0.52
9	合计	4,272,972,977.80	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	6,368,580.00	0.15
B	采矿业	253,827,048.00	6.02
C	制造业	2,829,051,350.46	67.05
D	电力、热力、燃气及水生产和	99,945,685.40	2.37

	供应业		
E	建筑业	19,461,560.60	0.46
F	批发和零售业	72,724,566.41	1.72
G	交通运输、仓储和邮政业	45,723,739.52	1.08
H	住宿和餐饮业	737,748.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	214,683,209.55	5.09
J	金融业	161,925,373.84	3.84
K	房地产业	11,183,994.00	0.27
L	租赁和商务服务业	22,118,610.60	0.52
M	科学研究和技术服务业	95,903,182.83	2.27
N	水利、环境和公共设施管理业	19,786,404.70	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,540,530.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,163,062.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	4,124,136.00	0.10
S	综合	386,910.58	0.01
	合计	3,860,655,692.49	91.50

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	000725	京东方 A	10,703,100	92,902,908.00	2.20
2	301396	宏景科技	263,688	87,438,940.80	2.07
3	300014	亿纬锂能	1,284,719	83,545,276.57	1.98
4	000630	铜陵有色	12,805,705	81,444,283.80	1.93
5	600584	长电科技	784,900	81,276,395.00	1.93
6	300033	同花顺	322,317	77,678,397.00	1.84
7	688268	华特气体	262,775	70,292,312.50	1.67
8	603259	药明康德	542,920	67,598,969.20	1.60
9	600418	江淮汽车	2,571,800	66,429,594.00	1.57
10	002600	领益智造	3,769,600	65,364,864.00	1.55
11	301536	星辰科技	464,700	59,811,537.00	1.42
12	001389	广合科技	246,400	58,458,400.00	1.39
13	603993	洛阳钼业	3,305,400	58,009,770.00	1.37
14	002466	天齐锂业	917,920	56,286,854.40	1.33
15	002008	大族激光	367,200	55,120,392.00	1.31
16	600547	山东黄金	2,373,801	54,811,065.09	1.30
17	605117	德业股份	513,900	54,565,902.00	1.29

18	600011	华能国际	7,132,300	54,134,157.00	1.28
19	300438	鹏辉能源	641,800	53,173,130.00	1.26
20	688388	嘉元科技	1,159,796	51,031,024.00	1.21
21	688025	杰普特	97,703	45,920,410.00	1.09
22	300604	长川科技	119,908	40,938,989.36	0.97
23	300395	菲利华	290,800	38,888,684.00	0.92
24	300870	欧陆通	111,680	38,606,659.20	0.91
25	002851	麦格米特	226,800	37,916,424.00	0.90
26	688390	固德威	339,678	36,858,459.78	0.87
27	300769	德方纳米	524,538	34,881,777.00	0.83
28	600549	厦门钨业	386,285	32,911,482.00	0.78
29	301086	鸿富瀚	155,381	32,518,135.68	0.77
30	688536	思瑞浦	88,845	32,347,576.05	0.77
31	688127	蓝特光学	323,161	31,540,513.60	0.75
32	688052	纳芯微	104,142	30,025,180.02	0.71
33	301018	申菱环境	236,875	27,385,118.75	0.65
34	600188	兖矿能源	1,514,883	26,919,470.91	0.64
35	601699	潞安环能	1,704,500	24,340,260.00	0.58
36	002281	光迅科技	91,099	23,406,977.06	0.55
37	300059	东方财富	1,135,208	23,135,539.04	0.55
38	688003	天准科技	174,807	22,252,931.10	0.53
39	688409	富创精密	71,938	22,031,012.50	0.52
40	002294	信立泰	686,800	21,902,052.00	0.52
41	688469	芯联集成	2,014,330	21,372,041.30	0.51
42	002913	奥士康	306,200	19,578,428.00	0.46
43	603115	海星股份	155,000	18,982,850.00	0.45
44	002436	兴森科技	366,300	18,662,985.00	0.44
45	600392	盛和资源	564,601	16,808,171.77	0.40
46	002812	恩捷股份	249,900	16,720,809.00	0.40
47	300548	长芯博创	57,200	15,901,600.00	0.38
48	002185	华天科技	708,055	15,796,707.05	0.37
49	601126	四方股份	243,000	15,357,600.00	0.36
50	600115	中国东航	3,982,000	15,171,420.00	0.36
51	003022	联泓新科	573,600	14,856,240.00	0.35
52	601688	华泰证券	701,300	14,460,806.00	0.34
53	603950	长源东谷	170,100	14,361,543.00	0.34
54	301246	宏源药业	517,900	13,931,510.00	0.33
55	688506	百利天恒	47,265	13,897,327.95	0.33
56	300308	中际旭创	10,800	13,716,000.00	0.33
57	600362	江西铜业	315,600	13,665,480.00	0.32
58	600497	驰宏锌锗	1,119,300	13,554,723.00	0.32
59	600985	淮北矿业	936,700	13,160,635.00	0.31
60	000783	长江证券	1,310,600	12,778,350.00	0.30

61	600961	株冶集团	388,200	12,573,798.00	0.30
62	601666	平煤股份	1,754,800	12,546,820.00	0.30
63	688195	腾景科技	62,607	12,056,856.06	0.29
64	603124	江南新材	63,200	11,817,136.00	0.28
65	300765	石药创新	420,100	11,439,323.00	0.27
66	300475	香农芯创	38,123	11,436,900.00	0.27
67	301377	鼎泰高科	20,706	11,406,935.40	0.27
68	600909	华安证券	1,010,480	11,226,432.80	0.27
69	601233	桐昆股份	518,500	11,225,525.00	0.27
70	000539	粤电力 A	1,643,500	11,192,235.00	0.27
71	002558	巨人网络	405,400	11,172,824.00	0.26
72	600026	中远海能	611,300	10,966,722.00	0.26
73	600160	巨化股份	206,000	10,920,060.00	0.26
74	000060	中金岭南	1,439,200	10,894,744.00	0.26
75	002738	中矿资源	177,900	10,494,321.00	0.25
76	603063	禾望电气	196,200	10,377,018.00	0.25
77	688628	优利德	104,004	10,290,155.76	0.24
78	688531	日联科技	56,776	10,097,043.84	0.24
79	300054	鼎龙股份	92,400	9,791,628.00	0.23
80	002716	湖南白银	1,210,200	9,790,518.00	0.23
81	301358	湖南裕能	129,000	9,787,230.00	0.23
82	601958	金钼股份	338,700	9,520,857.00	0.23
83	688392	骄成超声	41,812	9,498,850.16	0.23
84	601868	中国能建	3,507,600	9,365,292.00	0.22
85	000983	山西焦煤	1,602,800	9,296,240.00	0.22
86	000975	山金国际	537,500	9,137,500.00	0.22
87	301511	德福科技	59,500	8,559,075.00	0.20
88	000878	云南铜业	531,400	8,438,632.00	0.20
89	688633	星球石墨	281,814	8,378,330.22	0.20
90	001287	中电港	264,500	8,239,175.00	0.20
91	301603	乔锋智能	56,900	8,182,220.00	0.19
92	600331	宏达股份	743,600	8,172,164.00	0.19
93	300803	指南针	88,400	8,103,628.00	0.19
94	300790	宇瞳光学	304,460	7,949,450.60	0.19
95	688378	奥来德	125,013	7,750,806.00	0.18
96	603538	美诺华	237,800	7,740,390.00	0.18
97	603125	常青科技	230,100	7,533,474.00	0.18
98	301285	鸿日达	68,100	7,513,473.00	0.18
99	688027	国盾量子	14,744	7,431,123.44	0.18
100	002824	和胜股份	213,600	7,386,288.00	0.18
101	002493	荣盛石化	683,700	7,349,775.00	0.17
102	002643	万润股份	346,400	7,257,080.00	0.17
103	603806	福斯特	429,100	7,204,589.00	0.17

104	688667	菱电电控	53,287	7,121,807.55	0.17
105	002957	科瑞技术	129,600	7,107,264.00	0.17
106	600988	赤峰黄金	268,200	7,059,024.00	0.17
107	301099	雅创电子	73,900	7,057,450.00	0.17
108	603225	新凤鸣	355,600	6,987,540.00	0.17
109	601918	新集能源	812,000	6,975,080.00	0.17
110	600489	中金黄金	386,200	6,970,910.00	0.17
111	300602	飞荣达	135,900	6,958,080.00	0.16
112	300775	三角防务	313,659	6,913,044.36	0.16
113	301321	翰博高新	154,500	6,821,175.00	0.16
114	300843	胜蓝股份	43,100	6,734,375.00	0.16
115	601001	晋控煤业	380,600	6,618,634.00	0.16
116	002975	博杰股份	46,420	6,591,640.00	0.16
117	300724	捷佳伟创	91,400	6,452,840.00	0.15
118	600903	贵州燃气	965,800	6,412,912.00	0.15
119	301345	涛涛车业	27,700	6,398,700.00	0.15
120	603318	水发燃气	632,400	6,033,096.00	0.14
121	600113	浙江东日	177,600	5,892,768.00	0.14
122	600816	建元信托	2,379,400	5,805,736.00	0.14
123	688800	瑞可达	59,748	5,734,015.56	0.14
124	300861	美畅股份	223,500	5,629,965.00	0.13
125	301571	国科天成	85,200	5,553,336.00	0.13
126	300986	志特新材	316,000	5,419,400.00	0.13
127	003031	中瓷电子	29,200	5,264,760.00	0.12
128	688155	先惠技术	62,738	5,074,876.82	0.12
129	301205	联特科技	15,000	5,011,500.00	0.12
130	000572	海马汽车	1,345,900	4,979,830.00	0.12
131	300067	安诺其	881,300	4,776,646.00	0.11
132	301251	威尔高	89,400	4,763,232.00	0.11
133	002079	苏州固锝	313,800	4,716,414.00	0.11
134	600208	衢州发展	1,642,600	4,648,558.00	0.11
135	002990	盛视科技	58,200	4,597,800.00	0.11
136	688257	新锐股份	42,993	4,380,986.70	0.10
137	603200	上海洗霸	100,300	4,349,008.00	0.10
138	603317	天味食品	333,500	4,338,835.00	0.10
139	601567	三星电气	287,200	4,290,768.00	0.10
140	301280	珠城科技	84,060	4,250,914.20	0.10
141	603260	合盛硅业	86,600	4,179,316.00	0.10
142	002057	中钢天源	330,400	4,106,872.00	0.10
143	002833	弘亚数控	212,200	4,093,338.00	0.10
144	688239	航宇科技	67,243	4,023,148.69	0.10
145	002153	石基信息	556,100	4,020,603.00	0.10
146	688309	恒誉环保	65,901	4,012,052.88	0.10

147	603032	德新科技	146,700	3,946,230.00	0.09
148	600688	上海石化	1,328,800	3,893,384.00	0.09
149	300681	英搏尔	132,700	3,797,874.00	0.09
150	603178	圣龙股份	274,000	3,794,900.00	0.09
151	301051	信濠光电	195,428	3,791,303.20	0.09
152	301041	金百泽	108,900	3,675,375.00	0.09
153	603135	中重科技	292,340	3,537,314.00	0.08
154	301329	信音电子	144,600	3,512,334.00	0.08
155	605580	恒盛能源	126,400	3,489,904.00	0.08
156	688228	开普云	45,039	3,483,316.26	0.08
157	603095	越剑智能	243,000	3,479,760.00	0.08
158	002972	科安达	174,800	3,419,088.00	0.08
159	301219	腾远钴业	60,080	3,292,384.00	0.08
160	301072	中捷精工	78,600	3,223,386.00	0.08
161	688677	海泰新光	31,714	3,207,236.82	0.08
162	301499	维科精密	109,700	3,201,046.00	0.08
163	002756	永兴材料	55,900	3,166,176.00	0.08
164	688101	三达膜	188,517	3,116,186.01	0.07
165	603890	春秋电子	112,700	3,112,774.00	0.07
166	300848	美瑞新材	222,900	3,109,455.00	0.07
167	000586	汇源通信	235,200	3,106,992.00	0.07
168	002760	凤形股份	188,900	3,101,738.00	0.07
169	688255	凯尔达	111,558	3,101,312.40	0.07
170	002064	华峰化学	326,500	3,098,485.00	0.07
171	603216	梦天家居	150,600	3,097,842.00	0.07
172	605189	富春染织	256,900	3,095,645.00	0.07
173	301268	铭利达	220,500	3,082,590.00	0.07
174	605365	立达信	213,300	3,067,254.00	0.07
175	603327	福蓉科技	361,600	3,066,368.00	0.07
176	300365	恒华科技	668,300	3,060,814.00	0.07
177	300755	华致酒行	268,100	3,053,659.00	0.07
178	002577	雷柏科技	156,200	2,867,832.00	0.07
179	605218	伟时电子	171,900	2,841,507.00	0.07
180	300214	日科化学	276,900	2,838,225.00	0.07
181	600123	兰花科创	530,200	2,831,268.00	0.07
182	301548	崇德科技	31,600	2,805,132.00	0.07
183	300748	金力永磁	90,399	2,788,809.15	0.07
184	688350	富淼科技	80,683	2,785,983.99	0.07
185	301369	联动科技	11,300	2,768,500.00	0.07
186	301067	显盈科技	73,000	2,760,860.00	0.07
187	300538	同益股份	165,100	2,755,519.00	0.07
188	301328	维峰电子	38,400	2,734,080.00	0.06
189	002865	钧达股份	45,800	2,733,344.00	0.06

190	603895	天永智能	95,800	2,719,762.00	0.06
191	301252	同星科技	67,100	2,719,563.00	0.06
192	603819	神力股份	237,500	2,719,375.00	0.06
193	002460	赣锋锂业	41,572	2,718,808.80	0.06
194	000701	厦门信达	612,000	2,711,160.00	0.06
195	002184	海得控制	294,700	2,699,452.00	0.06
196	002845	同兴达	163,900	2,687,960.00	0.06
197	603206	嘉环科技	168,700	2,687,391.00	0.06
198	301418	协昌科技	47,600	2,659,888.00	0.06
199	600029	南方航空	510,600	2,644,908.00	0.06
200	688660	电气风电	306,703	2,643,779.86	0.06
201	300985	致远新能	68,100	2,621,850.00	0.06
202	603937	丽岛新材	186,300	2,611,926.00	0.06
203	002948	青岛银行	508,100	2,581,148.00	0.06
204	002320	海峡股份	409,800	2,569,446.00	0.06
205	000301	东方盛虹	219,012	2,507,687.40	0.06
206	001314	亿道信息	40,400	2,496,720.00	0.06
207	300782	卓胜微	22,660	2,483,082.80	0.06
208	300691	联合光电	154,200	2,437,902.00	0.06
209	301551	无线传媒	123,300	2,432,709.00	0.06
210	000810	创维数字	183,300	2,428,725.00	0.06
211	688211	中科微至	69,321	2,386,028.82	0.06
212	000629	钒钛股份	711,400	2,376,076.00	0.06
213	001373	翔腾新材	78,500	2,366,775.00	0.06
214	301127	武汉天源	113,800	2,357,936.00	0.06
215	300713	英可瑞	184,700	2,353,078.00	0.06
216	300823	建科智能	161,300	2,351,754.00	0.06
217	605168	三人行	46,400	2,349,696.00	0.06
218	300965	恒宇信通	55,400	2,346,744.00	0.06
219	300786	国林科技	93,600	2,346,552.00	0.06
220	688017	绿的谐波	5,588	2,335,001.68	0.06
221	605162	新中港	302,200	2,329,962.00	0.06
222	301061	匠心家居	66,400	2,328,648.00	0.06
223	001366	播恩集团	214,800	2,328,432.00	0.06
224	603733	仙鹤股份	86,000	2,322,860.00	0.06
225	300928	华安鑫创	80,400	2,321,952.00	0.06
226	001218	丽臣实业	105,200	2,320,712.00	0.06
227	002012	凯恩股份	362,000	2,320,420.00	0.05
228	600318	新力金融	384,800	2,316,496.00	0.05
229	300466	赛摩智能	328,700	2,314,048.00	0.05
230	300281	金明精机	383,500	2,312,505.00	0.05
231	002188	中天服务	471,400	2,309,860.00	0.05
232	300025	华星创业	549,400	2,307,480.00	0.05

233	002712	思美传媒	556,000	2,307,400.00	0.05
234	000576	甘化科工	349,000	2,292,930.00	0.05
235	300856	科思股份	214,400	2,285,504.00	0.05
236	002449	国星光电	292,300	2,265,325.00	0.05
237	300323	华灿光电	111,000	2,264,400.00	0.05
238	300154	瑞凌股份	300,900	2,262,768.00	0.05
239	300876	蒙泰高新	154,920	2,220,003.60	0.05
240	002402	和而泰	85,400	2,205,882.00	0.05
241	301090	华润材料	350,500	2,197,635.00	0.05
242	003042	中农联合	179,100	2,176,065.00	0.05
243	300112	万讯自控	331,200	2,050,128.00	0.05
244	002830	名雕股份	117,800	2,036,762.00	0.05
245	001339	智微智能	19,860	2,031,280.80	0.05
246	601882	海天精工	100,300	2,029,069.00	0.05
247	300694	蠡湖股份	209,500	2,011,200.00	0.05
248	603190	亚通精工	88,600	2,004,132.00	0.05
249	605588	冠石科技	29,800	2,001,666.00	0.05
250	688631	莱斯信息	42,196	1,979,414.36	0.05
251	688718	唯赛勃	123,925	1,979,082.25	0.05
252	300183	东软载波	188,800	1,972,960.00	0.05
253	688659	元琛科技	188,828	1,971,364.32	0.05
254	600135	乐凯胶片	246,100	1,966,339.00	0.05
255	001313	粤海饲料	275,800	1,955,422.00	0.05
256	300407	凯发电气	180,800	1,952,640.00	0.05
257	003027	同兴科技	111,800	1,948,674.00	0.05
258	300968	格林精密	202,000	1,947,280.00	0.05
259	300956	英力股份	173,000	1,944,520.00	0.05
260	603722	阿科力	49,100	1,944,360.00	0.05
261	300650	太龙股份	133,800	1,944,114.00	0.05
262	001324	长青科技	105,700	1,942,766.00	0.05
263	301439	泓淋电力	123,287	1,938,071.64	0.05
264	300844	山水比德	87,200	1,936,712.00	0.05
265	002909	集泰股份	392,000	1,936,480.00	0.05
266	600893	航发动力	50,500	1,936,170.00	0.05
267	301180	万祥科技	154,500	1,935,885.00	0.05
268	002820	桂发祥	230,300	1,934,520.00	0.05
269	300805	电声股份	266,800	1,934,300.00	0.05
270	002660	茂硕电源	297,500	1,933,750.00	0.05
271	001387	雪祺电气	151,400	1,933,378.00	0.05
272	002982	湘佳股份	183,200	1,932,760.00	0.05
273	301535	浙江华远	144,000	1,932,480.00	0.05
274	300659	中孚信息	203,400	1,932,300.00	0.05
275	300658	延江股份	169,000	1,931,670.00	0.05

276	301190	善水科技	120,400	1,930,012.00	0.05
277	300837	浙矿股份	81,200	1,929,312.00	0.05
278	300539	横河精密	94,700	1,929,039.00	0.05
279	603109	神驰机电	119,800	1,928,780.00	0.05
280	001278	一彬科技	125,400	1,928,652.00	0.05
281	603126	中材节能	306,000	1,927,800.00	0.05
282	301567	贝隆精密	55,700	1,927,777.00	0.05
283	300941	创识科技	140,400	1,927,692.00	0.05
284	002745	木林森	153,500	1,926,425.00	0.05
285	601199	江南水务	347,700	1,926,258.00	0.05
286	300597	吉大通信	272,000	1,925,760.00	0.05
287	000757	浩物股份	564,600	1,925,286.00	0.05
288	301121	紫建电子	60,100	1,924,402.00	0.05
289	002247	聚力文化	909,200	1,918,412.00	0.05
290	601963	重庆银行	190,300	1,918,224.00	0.05
291	603270	金帝股份	57,200	1,916,772.00	0.05
292	301516	中远通	135,300	1,914,495.00	0.05
293	603066	音飞储存	194,800	1,901,248.00	0.05
294	002976	瑞玛精密	75,220	1,895,544.00	0.04
295	600560	金自天正	171,000	1,894,680.00	0.04
296	301068	大地海洋	79,400	1,889,720.00	0.04
297	301212	联盛化学	80,700	1,884,345.00	0.04
298	301060	兰卫医学	229,800	1,877,466.00	0.04
299	002671	龙泉股份	505,200	1,874,292.00	0.04
300	600502	安徽建工	430,400	1,872,240.00	0.04
301	300864	南大环境	97,500	1,870,050.00	0.04
302	603256	宏和科技	7,000	1,857,310.00	0.04
303	603630	拉芳家化	145,000	1,853,100.00	0.04
304	600971	恒源煤电	267,600	1,846,440.00	0.04
305	300610	晨化股份	188,100	1,833,975.00	0.04
306	603162	海通发展	198,816	1,783,379.52	0.04
307	601975	招商南油	475,800	1,774,734.00	0.04
308	300905	宝丽迪	33,100	1,674,860.00	0.04
309	301225	恒勃股份	21,200	1,670,348.00	0.04
310	301197	工大科雅	43,800	1,656,516.00	0.04
311	301186	超达装备	40,080	1,643,280.00	0.04
312	688517	金冠电气	92,727	1,620,867.96	0.04
313	002348	高乐股份	153,700	1,619,998.00	0.04
314	301448	开创电气	35,400	1,606,452.00	0.04
315	300789	唐源电气	90,100	1,601,077.00	0.04
316	002811	郑中设计	142,900	1,599,051.00	0.04
317	605007	五洲特纸	118,300	1,584,037.00	0.04
318	300126	锐奇股份	273,900	1,583,142.00	0.04

319	300923	研奥股份	71,000	1,581,880.00	0.04
320	603085	天成自控	145,300	1,579,411.00	0.04
321	603386	骏亚科技	80,000	1,578,400.00	0.04
322	300195	长荣股份	268,500	1,576,095.00	0.04
323	301355	南王科技	161,100	1,575,558.00	0.04
324	301177	迪阿股份	57,113	1,574,605.41	0.04
325	301314	科瑞思	32,300	1,571,718.00	0.04
326	300992	泰福泵业	62,700	1,563,111.00	0.04
327	600768	宁波富邦	104,300	1,562,414.00	0.04
328	603276	恒兴新材	102,050	1,562,385.50	0.04
329	301337	亚华电子	56,100	1,559,580.00	0.04
330	600463	空港股份	204,100	1,557,283.00	0.04
331	002347	泰尔股份	266,200	1,557,270.00	0.04
332	001300	三柏硕	137,800	1,557,140.00	0.04
333	002566	益盛药业	257,800	1,557,112.00	0.04
334	300950	德固特	92,800	1,556,256.00	0.04
335	603048	浙江黎明	87,700	1,555,798.00	0.04
336	300701	森霸传感	162,500	1,555,125.00	0.04
337	300381	溢多利	276,200	1,552,244.00	0.04
338	301272	英华特	47,100	1,551,474.00	0.04
339	001230	劲旅环境	101,000	1,551,360.00	0.04
340	600830	香溢融通	194,600	1,550,962.00	0.04
341	301515	港通医疗	88,400	1,549,652.00	0.04
342	600299	安迪苏	197,400	1,549,590.00	0.04
343	002551	尚荣医疗	580,300	1,549,401.00	0.04
344	300795	米奥会展	181,000	1,549,360.00	0.04
345	688203	海正生材	155,245	1,549,345.10	0.04
346	603183	建研院	436,400	1,549,220.00	0.04
347	300675	建科院	130,700	1,548,795.00	0.04
348	001319	铭科精技	79,000	1,548,400.00	0.04
349	301320	豪江智能	120,000	1,548,000.00	0.04
350	301469	恒达新材	56,100	1,547,238.00	0.04
351	600081	东风科技	170,400	1,547,232.00	0.04
352	301260	格力博	114,500	1,546,895.00	0.04
353	300822	贝仕达克	132,200	1,546,740.00	0.04
354	603409	汇通控股	84,248	1,545,950.80	0.04
355	600099	林海股份	193,700	1,545,726.00	0.04
355	603758	秦安股份	172,900	1,545,726.00	0.04
356	000619	海螺新材	351,300	1,545,720.00	0.04
357	301032	新柴股份	166,200	1,545,660.00	0.04
358	301056	森赫股份	138,000	1,545,600.00	0.04
359	600148	长春一东	106,500	1,545,315.00	0.04
360	002666	德联集团	391,200	1,545,240.00	0.04

361	301167	建研设计	124,700	1,545,033.00	0.04
362	605258	协和电子	45,600	1,544,928.00	0.04
363	001209	洪兴股份	96,400	1,544,328.00	0.04
364	301505	苏州规划	95,900	1,543,990.00	0.04
365	001269	欧晶科技	74,300	1,543,954.00	0.04
366	688004	博汇科技	84,803	1,543,414.60	0.04
367	002442	龙星科技	313,000	1,543,090.00	0.04
368	300929	华骐环保	146,400	1,543,056.00	0.04
369	002767	先锋电子	93,100	1,542,667.00	0.04
370	301456	盘古智能	68,300	1,542,214.00	0.04
371	603041	美思德	148,700	1,542,019.00	0.04
372	300851	交大思诺	69,300	1,541,925.00	0.04
373	002949	华阳国际	155,900	1,541,851.00	0.04
374	603680	今创集团	157,100	1,541,151.00	0.04
375	300535	达威股份	113,000	1,540,190.00	0.04
376	600579	中化装备	186,400	1,539,664.00	0.04
377	002494	华斯股份	346,600	1,538,904.00	0.04
378	000702	正虹科技	309,900	1,537,104.00	0.04
379	003025	思进智能	109,100	1,536,128.00	0.04
380	300583	赛托生物	136,700	1,535,141.00	0.04
381	603022	新通联	192,000	1,534,080.00	0.04
382	300645	正元智慧	130,200	1,532,454.00	0.04
383	603956	威派格	243,200	1,532,160.00	0.04
384	603617	君禾股份	214,700	1,528,664.00	0.04
385	001206	依依股份	81,300	1,525,188.00	0.04
386	603600	永艺股份	171,300	1,519,431.00	0.04
387	601279	英利汽车	496,000	1,512,800.00	0.04
388	001368	通达创智	73,500	1,511,895.00	0.04
389	002813	路畅科技	79,700	1,506,330.00	0.04
390	300958	建工修复	141,500	1,505,560.00	0.04
391	600992	贵绳股份	174,200	1,501,604.00	0.04
392	002722	物产金轮	127,346	1,501,409.34	0.04
393	603739	蔚蓝生物	129,800	1,496,594.00	0.04
394	002111	威海广泰	166,200	1,495,800.00	0.04
395	300425	中建环能	399,200	1,493,008.00	0.04
396	600051	宁波联合	264,600	1,489,698.00	0.04
397	603711	香飘飘	133,500	1,483,185.00	0.04
398	301097	天益医疗	41,469	1,480,443.30	0.04
399	601061	中信金属	137,100	1,476,567.00	0.03
400	002234	民和股份	229,000	1,467,890.00	0.03
401	002863	今飞凯达	345,600	1,465,344.00	0.03
402	688068	热景生物	16,905	1,463,973.00	0.03
403	002758	浙农股份	184,400	1,456,760.00	0.03

404	301362	民爆光电	7,800	1,434,576.00	0.03
405	688182	灿勤科技	32,375	1,394,391.25	0.03
406	600929	雪天盐业	287,000	1,302,980.00	0.03
407	605151	西上海	73,400	1,292,574.00	0.03
408	600853	龙建股份	420,000	1,276,800.00	0.03
409	301390	经纬股份	39,100	1,261,366.00	0.03
410	688558	国盛智科	37,475	1,231,428.50	0.03
411	688443	智翔金泰	52,247	1,214,742.75	0.03
412	300838	浙江力诺	90,800	1,212,180.00	0.03
413	300434	金石亚药	107,700	1,209,471.00	0.03
414	688357	建龙微纳	40,935	1,206,354.45	0.03
415	603709	中源家居	88,700	1,200,998.00	0.03
416	300916	朗特智能	51,200	1,196,544.00	0.03
417	600469	风神股份	219,000	1,191,360.00	0.03
418	603519	立霸股份	77,800	1,190,340.00	0.03
419	301149	隆华新材	112,000	1,184,960.00	0.03
420	002687	乔治白	226,000	1,184,240.00	0.03
421	603275	众辰科技	31,100	1,183,977.00	0.03
422	300833	浩洋股份	39,100	1,180,038.00	0.03
423	605166	聚合顺	123,000	1,179,570.00	0.03
424	688162	巨一科技	49,812	1,177,555.68	0.03
425	603339	四方科技	82,400	1,177,496.00	0.03
426	605133	嵘泰股份	29,900	1,177,163.00	0.03
427	605369	拱东医疗	67,000	1,175,180.00	0.03
428	300826	测绘股份	83,880	1,174,320.00	0.03
429	603856	东宏股份	84,900	1,174,167.00	0.03
430	603060	国检集团	211,700	1,170,701.00	0.03
431	301587	中瑞股份	53,300	1,169,935.00	0.03
432	300647	超频三	196,500	1,169,175.00	0.03
433	300637	扬帆新材	112,500	1,167,750.00	0.03
434	001296	长江材料	60,900	1,167,453.00	0.03
434	603073	彩蝶实业	78,300	1,167,453.00	0.03
435	300906	日月明	46,800	1,166,724.00	0.03
436	300187	永清环保	231,000	1,166,550.00	0.03
436	301202	朗威股份	35,000	1,166,550.00	0.03
437	301166	优宁维	45,200	1,165,708.00	0.03
438	000573	粤宏远 A	329,200	1,165,368.00	0.03
439	002398	垒知集团	310,700	1,165,125.00	0.03
440	000548	湖南投资	284,800	1,164,832.00	0.03
441	301519	舜禹股份	107,300	1,164,205.00	0.03
442	300886	华业香料	58,500	1,164,150.00	0.03
443	002873	新天药业	159,000	1,163,880.00	0.03
444	688681	科汇股份	83,179	1,162,842.42	0.03

445	300930	屹通新材	40,800	1,162,800.00	0.03
446	301049	超越科技	65,100	1,162,686.00	0.03
447	301386	未来电器	56,400	1,162,404.00	0.03
448	688638	誉辰智能	37,292	1,162,391.64	0.03
449	603037	凯众股份	116,000	1,162,320.00	0.03
450	300978	东箭科技	143,300	1,162,163.00	0.03
451	603836	海程邦达	147,100	1,162,090.00	0.03
452	300176	鸿特科技	239,600	1,162,060.00	0.03
453	300922	天秦装备	76,700	1,162,005.00	0.03
454	002016	世荣兆业	290,500	1,162,000.00	0.03
455	002391	长青股份	238,600	1,161,982.00	0.03
456	600981	苏豪汇鸿	516,400	1,161,900.00	0.03
457	600386	北巴传媒	372,400	1,161,888.00	0.03
458	002677	浙江美大	210,100	1,161,853.00	0.03
459	301298	东利机械	100,400	1,161,628.00	0.03
460	605086	龙高股份	46,800	1,161,576.00	0.03
461	301429	森泰股份	74,100	1,161,147.00	0.03
462	301339	通行宝	113,500	1,161,105.00	0.03
463	300995	奇德新材	43,300	1,160,873.00	0.03
464	301290	东星医疗	42,600	1,160,850.00	0.03
465	301130	西点药业	48,400	1,160,632.00	0.03
466	600865	百大集团	141,700	1,160,523.00	0.03
467	301192	泰祥股份	61,400	1,160,460.00	0.03
468	605158	华达新材	181,300	1,160,320.00	0.03
469	301106	骏成科技	55,940	1,160,195.60	0.03
470	603706	东方环宇	67,100	1,160,159.00	0.03
471	300519	新光药业	97,900	1,160,115.00	0.03
472	002999	天禾股份	218,000	1,159,760.00	0.03
472	605001	威奥股份	212,800	1,159,760.00	0.03
473	301170	锡南科技	53,900	1,159,389.00	0.03
474	600854	春兰股份	284,800	1,159,136.00	0.03
475	000819	岳阳兴长	102,300	1,159,059.00	0.03
476	301083	百胜智能	88,000	1,158,960.00	0.03
477	603289	泰瑞机器	143,600	1,158,852.00	0.03
478	001277	速达股份	42,000	1,158,780.00	0.03
479	300512	中亚股份	169,900	1,158,718.00	0.03
480	001379	腾达科技	73,800	1,158,660.00	0.03
481	300625	三雄极光	127,600	1,158,608.00	0.03
482	000812	陕西金叶	373,600	1,158,160.00	0.03
483	605033	美邦股份	69,600	1,158,144.00	0.03
484	603900	莱绅通灵	205,700	1,158,091.00	0.03
485	603787	新日股份	127,400	1,158,066.00	0.03
486	002696	百洋股份	232,900	1,157,513.00	0.03

487	002576	通达动力	81,800	1,157,470.00	0.03
488	002835	同为股份	100,900	1,157,323.00	0.03
489	600455	博通股份	52,700	1,157,292.00	0.03
490	002802	洪汇新材	110,000	1,157,200.00	0.03
491	603958	哈森股份	68,300	1,157,002.00	0.03
492	301539	宏鑫科技	88,300	1,156,730.00	0.03
493	300673	佩蒂股份	86,000	1,156,700.00	0.03
494	603172	万丰股份	70,400	1,156,672.00	0.03
495	001311	多利科技	71,700	1,156,521.00	0.03
496	002144	宏达高科	117,400	1,156,390.00	0.03
497	300306	远方信息	119,200	1,156,240.00	0.03
498	605567	春雪食品	144,700	1,156,153.00	0.03
499	300150	世纪瑞尔	291,200	1,156,064.00	0.03
499	301359	东南电子	72,800	1,156,064.00	0.03
500	301006	迈拓股份	92,100	1,155,855.00	0.03
501	003028	振邦智能	52,600	1,155,622.00	0.03
502	000605	渤海股份	216,000	1,155,600.00	0.03
503	603810	丰山集团	103,800	1,155,294.00	0.03
504	001378	德冠新材	64,500	1,155,195.00	0.03
505	301100	风光股份	83,100	1,155,090.00	0.03
506	300977	深圳瑞捷	74,900	1,154,958.00	0.03
507	002968	新大正	136,500	1,154,790.00	0.03
508	603029	天鹅股份	82,100	1,154,326.00	0.03
509	300371	汇中股份	118,000	1,154,040.00	0.03
510	603506	南都物业	123,500	1,153,490.00	0.03
511	688565	力源科技	122,060	1,153,467.00	0.03
512	600561	江西长运	232,900	1,152,855.00	0.03
513	300239	东宝生物	216,200	1,152,346.00	0.03
514	002381	双箭股份	222,200	1,150,996.00	0.03
515	301552	科力装备	51,510	1,150,218.30	0.03
516	688156	路德科技	37,967	1,148,501.75	0.03
517	301037	保立佳	95,700	1,148,400.00	0.03
518	002933	新兴装备	44,400	1,147,740.00	0.03
519	301601	惠通科技	73,400	1,146,508.00	0.03
520	001201	东瑞股份	105,400	1,144,644.00	0.03
521	002819	东方中科	51,200	1,144,320.00	0.03
522	301050	雷电微力	34,200	1,143,648.00	0.03
523	600712	南宁百货	248,600	1,143,560.00	0.03
524	301380	挖金客	41,400	1,142,226.00	0.03
525	600697	欧亚集团	116,900	1,136,268.00	0.03
526	300220	金运激光	109,200	1,134,588.00	0.03
527	603381	永臻股份	73,300	1,129,553.00	0.03
528	002088	鲁阳节能	140,300	1,125,206.00	0.03

529	002790	瑞尔特	211,400	1,124,648.00	0.03
530	603096	新经典	84,000	1,123,920.00	0.03
531	603569	长久物流	212,000	1,123,600.00	0.03
532	603999	读者传媒	224,400	1,122,000.00	0.03
533	600615	鑫源智造	121,400	1,121,736.00	0.03
534	000565	渝三峡 A	197,300	1,120,664.00	0.03
535	603167	渤海轮渡	130,700	1,120,099.00	0.03
536	603976	正川股份	38,900	1,119,931.00	0.03
537	301019	宁波色母	62,800	1,119,724.00	0.03
538	301629	矽电股份	2,600	1,119,040.00	0.03
539	688013	天臣医疗	45,337	1,118,463.79	0.03
540	002942	新农股份	78,000	1,117,740.00	0.03
541	601368	绿城水务	273,200	1,117,388.00	0.03
542	002116	中国海诚	165,260	1,117,157.60	0.03
543	003030	祖名股份	54,300	1,115,865.00	0.03
544	000919	金陵药业	191,400	1,115,862.00	0.03
545	603759	海天股份	162,100	1,115,248.00	0.03
546	600356	恒丰纸业	149,900	1,110,759.00	0.03
547	301381	赛维时代	60,200	1,110,088.00	0.03
548	000030	富奥股份	286,600	1,109,142.00	0.03
549	601968	宝钢包装	282,300	1,106,616.00	0.03
550	003008	开普检测	64,800	1,106,136.00	0.03
551	002641	公元股份	286,400	1,105,504.00	0.03
552	300898	熊猫乳品	61,000	1,105,320.00	0.03
553	600097	开创国际	141,900	1,103,982.00	0.03
554	000590	古汉医药	135,100	1,103,767.00	0.03
555	603708	家家悦	128,600	1,103,388.00	0.03
556	600128	苏豪弘业	145,100	1,101,309.00	0.03
557	603151	邦基科技	100,200	1,101,198.00	0.03
558	600955	维远股份	74,800	1,101,056.00	0.03
559	000419	通程控股	244,000	1,100,440.00	0.03
560	000552	甘肃能化	489,000	1,095,360.00	0.03
561	603079	圣达生物	96,700	1,094,644.00	0.03
562	301116	益客食品	127,500	1,091,400.00	0.03
563	300966	共同药业	39,600	1,089,396.00	0.03
564	600689	上海三毛	112,200	1,088,340.00	0.03
565	600168	武汉控股	267,500	1,080,700.00	0.03
566	001219	青岛食品	93,000	1,065,780.00	0.03
567	300580	贝斯特	48,200	969,302.00	0.02
568	002876	三利谱	25,600	901,376.00	0.02
569	002737	葵花药业	80,200	899,042.00	0.02
570	001229	魅视科技	23,680	860,057.60	0.02
571	605018	长华集团	57,600	858,816.00	0.02

572	300354	东华测试	24,900	843,612.00	0.02
573	300596	利安隆	16,000	839,680.00	0.02
574	001358	兴欣新材	32,300	834,632.00	0.02
575	001215	千味央厨	22,400	826,560.00	0.02
576	688338	赛科希德	27,966	825,276.66	0.02
577	301273	瑞晨环保	26,160	824,301.60	0.02
578	603120	肯特催化	15,400	821,590.00	0.02
579	300855	图南股份	26,200	819,012.00	0.02
580	688737	中自科技	42,118	806,138.52	0.02
581	300810	中科海讯	31,600	802,008.00	0.02
582	301372	科净源	25,300	797,203.00	0.02
583	603344	星德胜	32,900	796,838.00	0.02
584	603948	建业股份	32,900	792,890.00	0.02
585	688351	微电生理	34,898	790,788.68	0.02
586	603615	茶花股份	48,900	789,735.00	0.02
587	603266	天龙股份	46,900	789,327.00	0.02
588	300643	万通智控	44,100	788,949.00	0.02
589	300550	和仁科技	59,172	788,762.76	0.02
590	001223	欧克科技	14,840	788,449.20	0.02
591	603661	恒林股份	19,700	788,000.00	0.02
592	600711	盛屯矿业	71,800	787,646.00	0.02
593	301270	汉仪股份	30,600	785,808.00	0.02
594	603076	乐惠国际	37,900	785,288.00	0.02
595	600316	洪都航空	28,100	785,114.00	0.02
596	301223	中荣股份	48,700	785,044.00	0.02
597	002799	环球印务	129,500	783,475.00	0.02
598	688395	正弦电气	35,389	782,096.90	0.02
599	300523	辰安科技	42,500	781,150.00	0.02
600	688193	仁度生物	14,120	780,836.00	0.02
601	688489	三未信安	34,398	780,834.60	0.02
602	001228	永泰运	30,500	779,275.00	0.02
603	301136	招标股份	70,900	778,482.00	0.02
604	603036	如通股份	53,800	777,948.00	0.02
605	002103	广博股份	132,500	777,775.00	0.02
606	301135	瑞德智能	47,220	777,713.40	0.02
607	301586	佳力奇	23,100	777,546.00	0.02
608	603237	五芳斋	62,800	777,464.00	0.02
609	605266	健之佳	53,100	777,384.00	0.02
610	603489	八方股份	27,800	777,288.00	0.02
611	001231	农心科技	42,600	777,024.00	0.02
612	603273	天元智能	60,000	777,000.00	0.02
613	603373	安邦护卫	21,440	776,985.60	0.02
614	688067	爱威科技	38,560	776,984.00	0.02

615	002923	润都股份	82,100	776,666.00	0.02
616	002337	赛象科技	175,300	776,579.00	0.02
617	301391	卡莱特	13,600	776,560.00	0.02
618	688420	美腾科技	36,854	776,513.78	0.02
619	603170	宝立食品	68,700	776,310.00	0.02
620	688015	交控科技	50,467	776,182.46	0.02
621	603059	倍加洁	32,000	776,000.00	0.02
622	688285	高铁电气	108,195	775,758.15	0.02
623	603004	鼎龙科技	32,200	775,698.00	0.02
624	001202	炬申股份	57,200	775,060.00	0.02
625	603367	辰欣药业	60,400	774,932.00	0.02
626	688557	兰剑智能	24,973	774,912.19	0.02
627	605003	众望布艺	37,800	774,900.00	0.02
628	300030	阳普医疗	133,300	774,473.00	0.02
629	301103	何氏眼科	51,700	774,466.00	0.02
630	600523	贵航股份	73,400	774,370.00	0.02
631	301383	天键股份	32,400	774,360.00	0.02
632	301063	海锅股份	46,200	774,312.00	0.02
633	603307	扬州金泉	33,145	773,935.75	0.02
634	301089	拓新药业	37,900	773,918.00	0.02
635	603280	南方路机	31,200	773,760.00	0.02
636	300902	国安达	47,200	773,608.00	0.02
637	600578	京能电力	119,900	773,355.00	0.02
638	688315	诺禾致源	61,799	773,105.49	0.02
639	603908	牧高笛	45,800	773,104.00	0.02
640	300797	钢研纳克	58,300	773,058.00	0.02
641	301059	金三江	69,700	772,973.00	0.02
642	603182	嘉华股份	67,800	772,920.00	0.02
643	002084	海鸥住工	222,100	772,908.00	0.02
644	001336	楚环科技	35,100	772,902.00	0.02
645	002574	明牌珠宝	186,200	772,730.00	0.02
646	301598	博科测试	15,600	772,512.00	0.02
647	603917	合力科技	65,800	772,492.00	0.02
648	600774	汉商集团	123,400	772,484.00	0.02
649	002877	智能自控	109,700	772,288.00	0.02
650	603587	地素时尚	69,500	772,145.00	0.02
651	603579	荣泰健康	45,500	772,135.00	0.02
652	301208	中亦科技	27,100	772,079.00	0.02
653	688579	地纬智能	101,663	771,622.17	0.02
654	301311	昆船智能	59,400	771,606.00	0.02
655	300904	威力传动	19,000	771,210.00	0.02
656	301279	金道科技	35,490	771,197.70	0.02
657	301262	海看股份	42,900	770,913.00	0.02

658	301211	亨迪药业	68,100	770,892.00	0.02
659	301199	迈赫股份	44,200	770,848.00	0.02
660	002363	隆基机械	128,000	770,560.00	0.02
661	688466	金科环境	60,052	770,467.16	0.02
662	300402	宝色股份	52,000	770,120.00	0.02
663	002732	燕塘乳业	62,100	770,040.00	0.02
664	301229	纽泰格	63,500	769,620.00	0.02
665	301512	智信精密	17,100	769,500.00	0.02
666	002763	汇洁股份	113,300	769,307.00	0.02
667	301353	普莱得	46,290	768,876.90	0.02
668	002644	佛慈制药	112,900	768,849.00	0.02
669	603332	苏州龙杰	76,000	768,360.00	0.02
670	301559	中集环科	63,000	767,970.00	0.02
671	603768	常青股份	84,100	767,833.00	0.02
672	600493	凤竹纺织	146,400	767,136.00	0.02
673	603161	科华控股	57,800	767,006.00	0.02
674	001328	登康口腔	29,600	766,936.00	0.02
675	603062	麦加芯彩	19,100	766,865.00	0.02
676	603860	中公高科	31,700	766,823.00	0.02
677	603028	赛福天	118,500	766,695.00	0.02
678	002890	弘宇股份	53,600	765,944.00	0.02
679	301088	戎美股份	66,600	763,236.00	0.02
680	603700	宁水集团	65,700	762,777.00	0.02
681	600283	钱江水利	95,000	761,900.00	0.02
682	300579	数字认证	36,800	761,760.00	0.02
683	001210	金房能源	33,480	761,335.20	0.02
684	603081	大丰实业	88,000	761,200.00	0.02
685	002661	克明食品	109,800	760,914.00	0.02
686	600178	东安动力	77,400	760,842.00	0.02
687	002194	武汉凡谷	77,600	760,480.00	0.02
688	603987	康德莱	110,200	760,380.00	0.02
689	301038	深水规院	47,000	759,520.00	0.02
690	603788	宁波高发	55,000	759,000.00	0.02
691	688227	品高股份	7,373	757,133.37	0.02
692	001317	三羊马	19,100	755,978.00	0.02
693	600630	龙头股份	77,600	755,824.00	0.02
694	603291	联合水务	94,000	755,760.00	0.02
695	688311	盟升电子	28,845	755,450.55	0.02
696	300200	高盟新材	65,700	754,893.00	0.02
697	300947	德必集团	59,200	754,800.00	0.02
698	301533	威马农机	31,900	754,754.00	0.02
699	301558	三态股份	122,300	754,591.00	0.02
700	002275	桂林三金	61,900	754,561.00	0.02

701	603116	红蜻蜓	132,500	752,600.00	0.02
702	603351	威尔药业	30,800	751,828.00	0.02
703	603926	铁流股份	42,500	751,825.00	0.02
704	603217	元利科技	33,500	751,405.00	0.02
705	300106	西部牧业	76,300	750,792.00	0.02
706	688196	卓越新能	20,876	749,448.40	0.02
707	603209	兴通股份	59,800	749,294.00	0.02
708	301370	国科恒泰	92,600	749,134.00	0.02
709	002344	海宁皮城	214,000	749,000.00	0.02
710	300240	飞力达	150,100	748,999.00	0.02
711	603329	上海雅仕	83,400	748,932.00	0.02
712	603231	索宝蛋白	50,600	748,880.00	0.02
713	300664	鹏鹞环保	176,500	748,360.00	0.02
714	603566	普莱柯	76,400	747,956.00	0.02
715	600526	菲达环保	181,900	747,609.00	0.02
716	605577	龙版传媒	84,800	747,088.00	0.02
717	001260	坤泰股份	47,700	746,505.00	0.02
718	000411	英特集团	82,600	745,878.00	0.02
719	002238	天威视讯	137,900	744,660.00	0.02
720	603755	日辰股份	32,800	744,232.00	0.02
721	603214	爱婴室	61,400	743,554.00	0.02
722	600333	长春燃气	148,100	743,462.00	0.02
723	688288	鸿泉技术	41,818	743,105.86	0.02
724	600234	科新发展	26,800	741,824.00	0.02
725	603511	爱慕股份	64,500	741,750.00	0.02
726	301507	民生健康	61,500	739,845.00	0.02
727	300828	锐新科技	36,600	738,954.00	0.02
728	300791	仙乐健康	46,100	738,522.00	0.02
729	603132	金徽股份	47,400	738,492.00	0.02
730	002186	全聚德	89,100	737,748.00	0.02
731	601068	中铝国际	170,600	736,992.00	0.02
732	603385	惠达卫浴	151,000	736,880.00	0.02
733	603970	中农立华	76,500	736,695.00	0.02
734	301356	天振股份	28,000	735,560.00	0.02
735	603071	物产环能	66,500	735,490.00	0.02
736	600833	第一医药	81,500	735,130.00	0.02
737	603057	紫燕食品	32,800	731,440.00	0.02
738	600616	金枫酒业	194,960	731,100.00	0.02
739	603808	歌力思	95,300	721,421.00	0.02
740	605296	神农集团	25,800	719,304.00	0.02
741	000529	广弘控股	167,800	714,828.00	0.02
742	002301	齐心集团	94,400	682,512.00	0.02
743	301286	侨源股份	11,500	666,885.00	0.02

744	000906	浙商中拓	94,600	476,784.00	0.01
745	603638	艾迪精密	19,800	464,310.00	0.01
746	301107	瑜欣电子	20,080	427,704.00	0.01
747	603130	云中马	9,900	413,325.00	0.01
748	301055	张小泉	9,600	407,712.00	0.01
749	002695	煌上煌	40,000	406,000.00	0.01
750	001308	康冠科技	19,400	404,684.00	0.01
751	688283	坤恒顺维	12,181	403,312.91	0.01
752	300907	康平科技	7,200	403,200.00	0.01
753	300488	恒锋工具	8,600	402,738.00	0.01
754	603992	松霖科技	12,400	401,760.00	0.01
755	688336	三生国健	7,547	400,745.70	0.01
756	603350	安乃达	12,700	400,685.00	0.01
757	688566	吉贝尔	15,598	399,152.82	0.01
758	600857	宁波中百	20,000	398,400.00	0.01
759	301203	国泰环保	9,400	397,150.00	0.01
760	605222	起帆电缆	17,000	396,440.00	0.01
761	688683	莱尔科技	10,451	396,301.92	0.01
762	688113	联测科技	11,288	396,208.80	0.01
763	688265	南模生物	11,446	395,917.14	0.01
764	002888	惠威科技	18,000	395,640.00	0.01
765	688030	山石网科	25,042	395,413.18	0.01
766	301122	采纳股份	13,400	394,094.00	0.01
767	601089	福元医药	24,200	393,976.00	0.01
768	301398	星源卓镁	11,200	393,232.00	0.01
769	603223	恒通股份	30,100	392,805.00	0.01
770	688356	键凯科技	5,085	391,951.80	0.01
771	688175	高凌信息	15,574	391,686.10	0.01
772	300918	南山智尚	36,500	391,280.00	0.01
773	300389	艾比森	30,500	391,010.00	0.01
774	300289	利德曼	70,400	390,720.00	0.01
775	300711	广哈通信	23,800	390,320.00	0.01
776	688232	新点软件	21,920	389,737.60	0.01
777	002375	亚厦股份	115,300	389,714.00	0.01
778	688129	东来技术	14,875	389,576.25	0.01
779	688569	铁科轨道	24,088	389,021.20	0.01
780	300753	爱朋医疗	20,541	388,841.13	0.01
781	688516	奥特维	6,772	388,645.08	0.01
782	002172	澳洋健康	137,800	388,596.00	0.01
783	002441	众业达	49,800	388,440.00	0.01
784	603790	雅运股份	18,200	388,388.00	0.01
785	600796	钱江生化	83,700	388,368.00	0.01
786	300695	兆丰股份	7,800	388,362.00	0.01

787	000850	华茂股份	110,600	388,206.00	0.01
788	301163	宏德股份	17,500	388,150.00	0.01
789	300915	海融科技	19,600	388,080.00	0.01
790	000633	合金投资	81,500	387,940.00	0.01
791	300993	玉马科技	39,900	387,828.00	0.01
792	002401	中远海科	33,400	387,774.00	0.01
793	688586	江航装备	33,171	387,768.99	0.01
794	603878	武进不锈	75,400	387,556.00	0.01
795	002295	精艺股份	45,700	387,536.00	0.01
796	001256	炜冈科技	14,200	387,518.00	0.01
797	301565	中仑新材	17,000	387,430.00	0.01
798	600793	宜宾纸业	32,200	387,366.00	0.01
799	301126	达嘉维康	45,300	387,315.00	0.01
800	605118	力鼎光电	11,100	387,279.00	0.01
801	300818	耐普矿机	20,490	387,261.00	0.01
802	301578	辰奕智能	18,990	387,206.10	0.01
803	688501	青达环保	20,166	387,187.20	0.01
804	300577	开润股份	26,500	387,165.00	0.01
805	002825	纳尔股份	47,100	387,162.00	0.01
806	002403	爱仕达	43,400	387,128.00	0.01
807	003003	天元股份	38,900	387,055.00	0.01
808	300746	汉嘉数智	35,800	386,998.00	0.01
809	688057	金达莱	25,113	386,991.33	0.01
810	603648	畅联股份	45,100	386,958.00	0.01
811	300768	迪普科技	28,100	386,937.00	0.01
812	600834	申通地铁	58,801	386,910.58	0.01
813	603101	汇嘉时代	62,000	386,880.00	0.01
814	301108	洁雅股份	16,400	386,876.00	0.01
815	603585	苏利股份	28,300	386,861.00	0.01
816	688251	井松智能	15,091	386,782.33	0.01
817	688267	中触媒	19,632	386,750.40	0.01
818	603282	亚光股份	27,100	386,717.00	0.01
819	002040	南 京 港	51,900	386,655.00	0.01
820	301024	霍普股份	10,500	386,610.00	0.01
821	688533	上声电子	18,533	386,598.38	0.01
822	605169	洪通燃气	43,480	386,537.20	0.01
823	600802	福建水泥	93,800	386,456.00	0.01
824	001222	源飞宠物	29,100	386,448.00	0.01
825	000868	安凯客车	118,500	386,310.00	0.01
826	600137	浪莎股份	23,800	386,274.00	0.01
827	000011	深物业 A	59,600	386,208.00	0.01
828	300796	贝斯美	61,400	386,206.00	0.01
829	301275	汉朔科技	8,600	386,140.00	0.01

830	688657	浩辰软件	10,794	386,101.38	0.01
831	301151	冠龙节能	23,400	386,100.00	0.01
832	301602	超研股份	28,100	386,094.00	0.01
833	601086	国芳集团	58,200	385,866.00	0.01
834	300897	山科智能	27,700	385,861.00	0.01
835	605138	盛泰集团	69,900	385,848.00	0.01
836	600724	宁波富达	76,100	385,827.00	0.01
837	600778	友好集团	78,900	385,821.00	0.01
838	603798	康普顿	28,200	385,776.00	0.01
839	301025	读客文化	49,700	385,672.00	0.01
840	605500	森林包装	62,400	385,632.00	0.01
841	600814	杭州解百	63,200	385,520.00	0.01
842	600444	国机通用	29,700	385,506.00	0.01
843	600250	南京商旅	50,000	385,500.00	0.01
844	600679	上海凤凰	43,200	385,344.00	0.01
845	301503	智迪科技	14,000	385,140.00	0.01
846	688236	春立医疗	26,632	385,098.72	0.01
847	603238	诺邦股份	35,000	385,000.00	0.01
848	301528	多浦乐	4,700	384,930.00	0.01
849	688480	赛恩斯	4,394	384,870.46	0.01
850	301258	富士莱	16,900	384,813.00	0.01
851	301198	喜悦智行	28,700	384,580.00	0.01
852	605089	味知香	18,300	384,117.00	0.01
853	603515	欧普照明	23,500	383,990.00	0.01
854	002333	罗普斯金	82,400	383,984.00	0.01
855	301633	港迪技术	8,200	383,842.00	0.01
856	688301	奕瑞科技	3,095	383,780.00	0.01
857	301036	双乐股份	17,500	383,775.00	0.01
858	688152	麒麟信安	13,950	383,346.00	0.01
859	001225	和泰机电	9,700	383,247.00	0.01
860	301033	迈普医学	7,400	383,246.00	0.01
861	000526	学大教育	15,100	383,238.00	0.01
862	000553	安道麦 A	71,600	383,060.00	0.01
863	300441	鲍斯股份	58,600	382,658.00	0.01
864	603355	莱克电气	14,500	382,510.00	0.01
865	301113	雅艺科技	25,640	382,292.40	0.01
866	002590	万安科技	38,200	382,000.00	0.01
867	603208	江山欧派	35,700	381,990.00	0.01
868	603159	上海亚虹	22,100	381,667.00	0.01
869	603666	亿嘉和	13,800	381,156.00	0.01
870	301332	德尔玛	49,800	380,970.00	0.01
871	603310	巍华新材	25,900	380,471.00	0.01
872	300105	龙源技术	53,800	380,366.00	0.01

873	002889	东方嘉盛	36,700	380,212.00	0.01
874	301577	美信科技	4,900	379,946.00	0.01
875	603070	万控智造	30,200	379,916.00	0.01
876	688276	百克生物	27,225	379,516.50	0.01
877	688526	科前生物	31,340	379,214.00	0.01
878	300717	华信新材	17,800	379,140.00	0.01
879	003013	地铁设计	26,100	378,711.00	0.01
880	601065	江盐集团	56,400	378,444.00	0.01
881	002404	嘉欣丝绸	66,100	378,092.00	0.01
882	002362	汉王科技	24,300	377,865.00	0.01
883	301371	敷尔佳	14,530	377,780.00	0.01
884	002748	世龙实业	36,000	377,280.00	0.01
885	603153	上海建科	29,700	376,596.00	0.01
886	603136	天目湖	44,900	376,262.00	0.01
887	601003	柳钢股份	111,600	376,092.00	0.01
888	603309	维力医疗	33,500	375,870.00	0.01
889	002991	甘源食品	9,500	375,345.00	0.01
890	002858	力盛体育	34,400	375,304.00	0.01
891	603392	万泰生物	13,900	374,883.00	0.01
892	301048	金鹰重工	43,500	374,535.00	0.01
893	603365	水星家纺	24,000	373,680.00	0.01
894	002282	博深股份	66,300	373,269.00	0.01
895	603848	好太太	27,300	372,918.00	0.01
896	603069	海汽集团	29,700	372,735.00	0.01
897	003037	三和管桩	68,000	372,640.00	0.01
898	300858	科拓生物	24,500	372,155.00	0.01
899	605268	王力安防	41,400	371,772.00	0.01
900	301234	五洲医疗	11,300	371,657.00	0.01
901	000151	中成股份	34,700	371,290.00	0.01
902	600232	金鹰股份	58,901	371,076.30	0.01
903	000683	博源化工	64,400	370,944.00	0.01
904	601158	重庆水务	96,000	370,560.00	0.01
905	603230	内蒙新华	42,400	370,152.00	0.01
906	002412	汉森制药	67,300	370,150.00	0.01
907	001217	华尔泰	43,900	370,077.00	0.01
908	603689	皖天然气	53,400	370,062.00	0.01
909	000726	鲁 泰 A	68,100	369,783.00	0.01
910	601077	渝农商行	60,500	369,655.00	0.01
911	300439	美康生物	46,000	369,380.00	0.01
912	000965	天保基建	126,400	369,088.00	0.01
913	300653	正海生物	25,700	369,052.00	0.01
914	301206	三元生物	16,600	369,018.00	0.01
915	003011	海象新材	20,300	368,851.00	0.01

916	003039	顺控发展	33,500	368,835.00	0.01
917	300387	富邦科技	54,300	368,697.00	0.01
918	605339	南侨食品	30,800	367,752.00	0.01
919	603137	恒尚节能	28,400	367,496.00	0.01
920	300729	乐歌股份	38,200	367,484.00	0.01
921	002852	道道全	51,800	367,262.00	0.01
922	000600	建投能源	41,800	365,750.00	0.01
923	605337	李子园	44,600	365,720.00	0.01
924	603967	中创物流	35,300	365,355.00	0.01
925	600573	惠泉啤酒	41,000	364,900.00	0.01
926	301277	新天地	41,500	363,125.00	0.01
927	603639	海利尔	36,600	363,072.00	0.01
928	600399	抚顺特钢	88,200	362,502.00	0.01
929	603194	中力股份	9,900	361,944.00	0.01
930	600249	两面针	81,000	360,450.00	0.01
931	300743	天地数码	24,600	358,914.00	0.01
932	605300	佳禾食品	35,100	342,225.00	0.01
933	601298	青岛港	24,400	196,420.00	0.00
934	600795	国电电力	300	1,401.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603993	洛阳钼业	136,889,073.23	9.22
2	688256	寒武纪	128,720,000.64	8.67
3	688167	炬光科技	122,536,549.26	8.25
4	601869	长飞光纤	122,476,408.00	8.25
5	300394	天孚通信	120,063,434.13	8.09
6	300308	中际旭创	115,111,230.36	7.75
7	300750	宁德时代	108,293,862.80	7.29
8	000630	铜陵有色	106,946,016.69	7.20
9	002916	深南电路	106,001,836.46	7.14
10	000725	京东方 A	103,855,359.00	6.99
11	301396	宏景科技	101,879,882.25	6.86
12	300033	同花顺	101,443,793.73	6.83
13	300014	亿纬锂能	100,499,377.61	6.77
14	002475	立讯精密	97,810,902.29	6.59
15	688025	杰普特	96,112,453.07	6.47
16	001309	德明利	95,300,810.00	6.42
17	301308	江波龙	94,711,197.75	6.38
18	300548	长芯博创	93,969,269.86	6.33
19	605117	德业股份	91,343,104.00	6.15

20	002281	光迅科技	90,548,898.24	6.10
21	002008	大族激光	89,655,553.00	6.04
22	300274	阳光电源	88,514,317.94	5.96
23	002384	东山精密	82,324,755.28	5.54
24	300438	鹏辉能源	80,764,449.49	5.44
25	600418	江淮汽车	80,292,703.00	5.41
26	002466	天齐锂业	79,554,271.82	5.36
27	600584	长电科技	79,085,627.58	5.33
28	300604	长川科技	78,833,058.00	5.31
29	600150	中国船舶	78,215,008.06	5.27
30	300870	欧陆通	76,626,927.40	5.16
31	300475	香农芯创	76,173,580.82	5.13
32	688268	华特气体	75,889,472.58	5.11
33	688536	思瑞浦	73,440,998.76	4.95
34	300395	菲利华	71,824,899.96	4.84
35	600547	山东黄金	69,383,905.20	4.67
36	002600	领益智造	67,973,117.00	4.58
37	603259	药明康德	67,780,141.20	4.56
38	600011	华能国际	67,423,494.00	4.54
39	688498	源杰科技	66,420,894.79	4.47
40	301511	德福科技	65,964,280.00	4.44
41	002463	沪电股份	64,354,676.00	4.33
42	688388	嘉元科技	63,376,793.58	4.27
43	300751	迈为股份	63,175,486.81	4.25
44	001389	广合科技	62,559,366.60	4.21
45	300857	协创数据	62,184,822.97	4.19
46	603986	兆易创新	61,961,029.72	4.17
47	688390	固德威	56,006,120.44	3.77
48	601126	四方股份	55,110,454.00	3.71
49	300502	新易盛	54,635,972.00	3.68
50	300769	德方纳米	52,594,147.61	3.54
51	301536	星宸科技	52,021,847.64	3.50
52	002460	赣锋锂业	51,000,823.30	3.43
53	002851	麦格米特	50,899,285.00	3.43
54	600188	兖矿能源	50,579,651.11	3.41
55	002709	天赐材料	48,630,105.97	3.27
56	600362	江西铜业	48,184,087.51	3.24
57	300136	信维通信	41,723,774.28	2.81
58	688127	蓝特光学	40,768,316.81	2.75
59	002738	中矿资源	40,720,254.20	2.74
60	300017	网宿科技	39,142,801.00	2.64
61	601868	中国能建	39,116,520.00	2.63
62	688627	精智达	39,015,342.93	2.63

63	002812	恩捷股份	38,690,862.93	2.61
64	301358	湖南裕能	38,441,680.67	2.59
65	688052	纳芯微	37,812,975.36	2.55
66	300408	三环集团	37,434,815.00	2.52
67	002957	科瑞技术	36,996,462.11	2.49
68	601288	农业银行	36,825,603.00	2.48
69	301550	斯菱智驱	36,662,061.81	2.47
70	601872	招商轮船	35,606,801.00	2.40
71	601699	潞安环能	34,976,081.00	2.36
72	688003	天准科技	34,865,731.37	2.35
73	300620	光库科技	33,849,396.00	2.28
74	688012	中微公司	32,667,372.42	2.20
75	300059	东方财富	32,394,512.80	2.18
76	300454	深信服	31,921,425.00	2.15
77	600549	厦门钨业	31,834,575.80	2.14
78	002294	信立泰	31,719,826.67	2.14
79	301018	申菱环境	31,196,751.27	2.10
80	300418	昆仑万维	30,934,224.00	2.08
81	301086	鸿富瀚	30,733,358.20	2.07
82	688525	佰维存储	30,010,564.39	2.02
83	603179	新泉股份	29,702,807.20	2.00

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	301308	江波龙	153,358,405.41	10.33
2	601869	长飞光纤	152,076,767.85	10.24
3	300308	中际旭创	144,097,066.03	9.70
4	688256	寒武纪	134,704,876.74	9.07
5	300394	天孚通信	130,031,784.89	8.76
6	688167	炬光科技	129,138,083.91	8.70
7	300274	阳光电源	124,806,972.25	8.40
8	001309	德明利	114,752,781.69	7.73
9	300750	宁德时代	110,371,702.16	7.43
10	002916	深南电路	108,192,849.75	7.29
11	002475	立讯精密	106,161,830.50	7.15
12	002384	东山精密	105,443,217.07	7.10
13	300548	长芯博创	86,571,714.00	5.83
14	300475	香农芯创	85,428,731.26	5.75
15	300857	协创数据	79,517,439.69	5.35
16	002281	光迅科技	77,985,236.00	5.25
17	688498	源杰科技	77,830,169.04	5.24

18	301511	德福科技	76,248,647.72	5.13
19	603986	兆易创新	76,029,485.06	5.12
20	002463	沪电股份	71,355,915.00	4.81
21	688025	杰普特	69,965,110.72	4.71
22	301396	宏景科技	69,753,404.00	4.70
23	600150	中国船舶	68,866,230.55	4.64
24	002008	大族激光	68,041,925.97	4.58
25	603993	洛阳钼业	63,277,990.00	4.26
26	300604	长川科技	61,761,527.48	4.16
27	002709	天赐材料	60,778,027.60	4.09
28	300751	迈为股份	59,778,632.70	4.03
29	300870	欧陆通	54,423,878.00	3.66
30	300502	新易盛	53,374,219.00	3.59
31	688536	思瑞浦	52,289,357.41	3.52
32	300033	同花顺	51,827,579.33	3.49
33	300620	光库科技	49,054,566.78	3.30
34	000338	潍柴动力	48,232,486.38	3.25
35	601872	招商轮船	46,954,047.19	3.16
36	300438	鹏辉能源	44,834,697.10	3.02
37	600487	亨通光电	43,563,263.28	2.93
38	000792	盐湖股份	42,791,294.00	2.88
39	300136	信维通信	42,292,630.14	2.85
40	002460	赣锋锂业	42,269,075.93	2.85
41	300408	三环集团	41,776,514.30	2.81
42	688268	华特气体	41,753,885.79	2.81
43	601126	四方股份	41,038,165.00	2.76
44	603929	亚翔集成	40,406,020.98	2.72
45	002371	北方华创	40,198,359.90	2.71
46	000725	京东方 A	39,569,744.00	2.66
47	688627	精智达	38,542,210.60	2.60
48	300017	网宿科技	37,756,303.67	2.54
49	300395	菲利华	37,352,945.00	2.52
50	688525	佰维存储	36,520,696.48	2.46
51	601288	农业银行	35,590,822.00	2.40
52	300567	精测电子	33,357,676.00	2.25
53	300418	昆仑万维	33,326,910.22	2.24
54	600362	江西铜业	33,115,312.58	2.23
55	000063	中兴通讯	33,042,901.00	2.23
56	603799	华友钴业	32,670,131.00	2.20
57	301550	斯菱智驱	32,569,258.81	2.19
58	688012	中微公司	32,194,006.59	2.17
59	300014	亿纬锂能	31,057,048.60	2.09
60	688521	芯原股份	29,825,966.00	2.01

61	688008	澜起科技	29,717,479.27	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	10,127,390,542.70
卖出股票收入（成交）总额	8,025,245,812.72

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	22,403,683.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,403,683.62

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 智 远 量 化 选 股 混 合 A	16,680	69,579.01	578,455,224.54	49.84	582,122,663.71	50.16
国 金 智 远 量 化 选 股 混 合 C	66,434	32,637.13	1,029,460,965.64	47.48	1,138,754,241.81	52.52
合计	83,114	40,050.93	1,607,916,190.18	48.30	1,720,876,905.52	51.70

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	国金智远量化选股混合 A	2,130,677.65	0.1836
	国金智远量化选股混合 C	262,834.80	0.0121
	合计	2,393,512.45	0.0719

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	国金智远量化选股混合 A	50~100
	国金智远量化选股混合 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国金智远量化选股混合 A	0~10
	国金智远量化选股混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金智远量化选股混合 A	国金智远量化选股混合 C
基金合同生效日（2025 年 11 月 4 日）基金份额总额	448,037,776.78	1,010,031,922.58
本报告期期初基金份额总额	448,037,776.78	1,010,031,922.58
本报告期基金总申购份额	1,174,072,881.25	2,484,052,823.92
减：本报告期基金总赎回份额	461,532,769.78	1,325,869,539.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,160,577,888.25	2,168,215,207.45

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	3	18,152,636.35	100.00	8,094,393.6	100.00	-

		5.42		1		
--	--	------	--	---	--	--

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(%)
华泰证券	-	-	3,116,353,000.00	100.00	-	-

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	《国金智远量化选股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	《国金智远量化选股混合型证券投资基金（国金智远量化选股混合 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	《国金智远量化选股混合型证券投资基金（国金智远量化选股混合 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	《关于国金智远量化选股混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、基金转换及定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 27 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	《国金智远量化选股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
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	《国金智远量化选股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
14	《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“中证全指指数收益率*87%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%+中债-1-3 年国债及政策性金融债财富(总值)指数收益率*5%+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、国金智远量化选股混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金智远量化选股混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金智远量化选股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