

国海证券量化优选一年持有期股票型集合 资产管理计划 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 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。

本报告中财务资料已经审计。上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 8 月 23 日起至 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	50

8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	70
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	70
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划	
基金简称	国海量化优选一年持有股票	
场内简称	-	
基金主代码	970041	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 23 日	
基金管理人	国海证券股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	444,924,658.68 份	
基金合同存续期	本集合计划存续期限为自本合同生效之日起 3 年。本资产管理合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	970041	970042
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	51,286,923.65 份	393,637,735.03 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保障必要流动性的前提下，谋求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划将利用多因子策略研究框架，找到优质股票的共性（比如低估值、高成长、超预期、盈利稳定等），筛选出能持续稳定跑赢中证 500 指数的股票组合，并利用多种风险控制技术优化投资组合的收益与风险，在可控的风险承受范围内力争获取较高收益。多因子模型因子主要包括价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征	本集合计划为股票型集合计划，理论上其风险收益水平高于货币市

	场基金和货币型集合资产管理计划、债券型基金和债券型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。
--	--

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		国海证券股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳琛	余宏伟
	联系电话	021-61018068	021-68089632
	电子邮箱	ouyc@ghzq.com.cn	yuhongwei1@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		95563	95588
传真		021-61018090	010-66105798
注册地址		广西桂林市辅星路 13 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区福佑路 8 号 11 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		何春梅	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ghzq.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号 25 层
注册登记机构	国海证券股份有限公司	上海市黄浦区福佑路 8 号 11 楼
-	-	-

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 8 月 23 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
本期已实现收益	-611,153.90	-8,531,118.53
本期利润	2,548,564.14	-12,143,449.72
加权平均基金份额本期利润	0.0470	-0.0341
本期加权平均净值利润率	2.71%	-1.97%

本期基金份额净值增长率	3.06%	2.98%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	33,434,511.85	256,131,381.05
期末可供分配基金份额利润	0.6519	0.6507
期末基金资产净值	89,653,803.38	687,620,087.45
期末基金份额净值	1.7481	1.7468
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	3.06%	2.98%

注：1、本基金合同于 2021 年 8 月 23 日生效，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。详情请参阅相关公告。

2、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。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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金于 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）确认赎回份额 6,248,348.38 份，所确认份额的申请日为 2021 年 8 月 20 日，该部分份额变动视为本报告期的份额变动。

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

国海量化优选一年持有股票 A

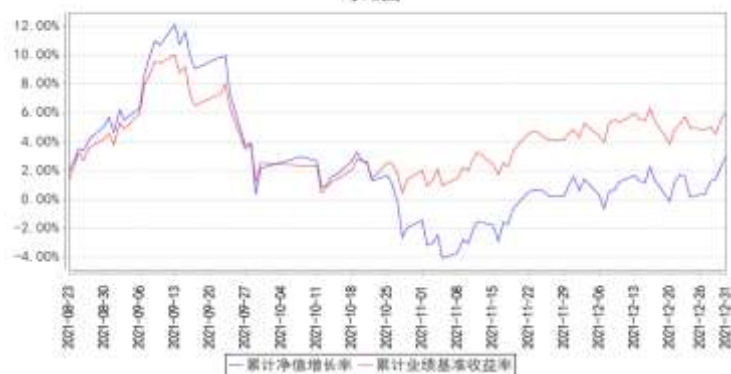
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.90%	3.43%	0.72%	-2.54%	0.18%
自基金合同生效起至今	3.06%	1.10%	6.05%	0.89%	-2.99%	0.21%

国海量化优选一年持有股票 C

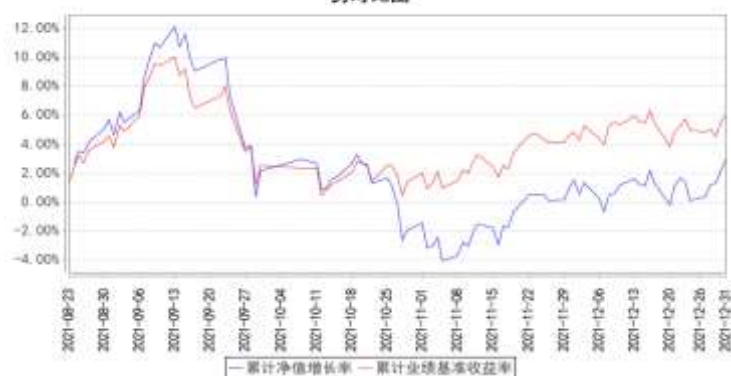
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.81%	0.90%	3.43%	0.72%	-2.62%	0.18%
自基金合同生效起至今	2.98%	1.12%	6.05%	0.89%	-3.07%	0.23%

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

国海量化优选一年持有股票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

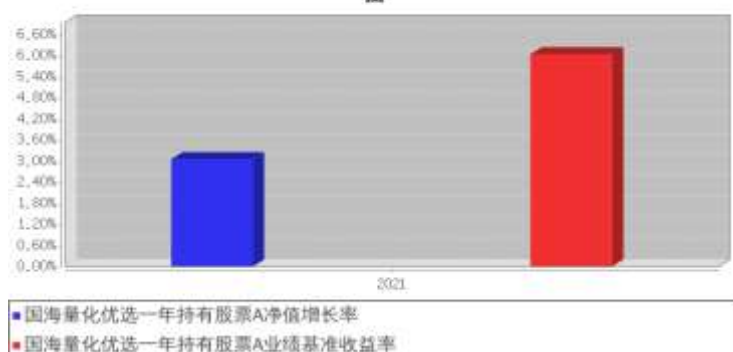


国海量化优选一年持有股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

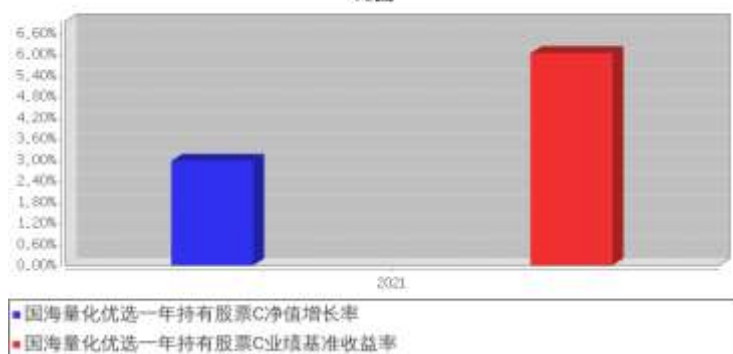


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海量化优选一年持有股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国海量化优选一年持有股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日）
-	-
其他指标	报告期末（2021年12月31日）
-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

国海量化优选一年持有股票 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：报告期间无利润分配。

§ 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

国海证券是国内首批设立并在广西壮族自治区内注册的唯一一家全国性综合类证券公司，是一家牌照齐全，涵盖证券、基金、期货、直投等多元业务体系的全国性上市综合金融服务企业。截至 2021 年 12 月 31 日，本集合计划管理人共管理了 2 只参照公开募集证券投资基金管理的集合计划：国海六个月滚动债券型集合资产管理计划、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划。本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

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		
秦海燕	本基金的基金经理	2021 年 8 月 23 日	-	15	秦海燕女士，华东师范大学硕士研究生，现任国海证券股份有限公司证券资产管理分公司量化投资部高级投资经理、量化投资总监，华东师范大学硕士研究生。十五年股票研究投资经验。曾先后在天治基金、滚石投资担任研究员、研究总监等职务，其中有 5 年公募基金投资管理经验，期间管理资产规模超 20 亿元。

注：对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

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
-	公募基金	-	-	-
-	私募资产管理计划	-	-	-
-	其他组合	-	-	-
-	合计	-	-	-

注：本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理，薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或与产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国海证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国海证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量 5% 的情况。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

报告期内，本基金采用的中证 500 指数增强策略受到三季度末的市场风格快速切换的影响，

出现较大幅度的回撤。量化模型基于长期历史数据回测，虽然会根据最新市场情况进行调整，但不可避免有所滞后。回看近两年历史，风格切换时有发生，量化选股策略无法预判市场突然性的变动，但在策略构建时已经经历过多次冲击的检验。无论是基于历史回测还是实盘运作，结果表明选股策略在较长时间内有较大概率能获取超额收益。而从事后看，经历9月至10月的回撤过后，11月以来，多因子选股策略重新获取正超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.7481 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为 3.06%；C 类份额基金净值为 1.7468 元，本报告期份额净值增长率为 2.98%，同期业绩比较基准收益率为 0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前三季度，国内经济总体保持恢复状态，增速有所放缓，累计同比增长 9.8%。但整体下半年，因为去年同期较高的基数，国内局部疫情有所反复等因素影响，三季度经济增速 4.9%，环比明显回落。同时，当前全球经济不确定性因素较多，奥密克戎与德尔塔在美国等主要发达经济体依然肆虐，而由于美联储缩减购债的节奏加快，未来全球总需求收缩等，给宏观经济增长造成了一定压力。12月召开的中央经济工作会议明确了当前的形势，以“稳字当头、稳中求进”为明年工作重点，可以预期明年逆周期调整的政策将进一步延续。

市场方面，A 股市场上半年经历了抱团股崩溃，中小盘崛起，给量化选股策略创了较好的市场环境；而时至三季度末四季度初经历了市场风格的快速切换，采掘、有色金属、钢铁等周期类行业在前期大幅上扬后，遭遇资金迅速撤离。而前期调整幅度较大的食品饮料等板块出现一定程度的回暖，在 10 月初的一段时间内，形成市场风格快速切换，少数板块支撑指数的局面，市场热度迅速下降，成交回落至万亿以下，同时多次出现三千只股票下跌的情况。后续市场相对平稳，但仍缺乏演绎的主线，在多个风格板块间持续轮动。

展望 2022 年，中证 500 指数当前指数估值仍处于历史较低位置，同时指数盈利能力与成长趋势有望延续，当前时间点的配置价值较好。同时，我们将继续对量化选股模型进行改进与迭代，力争获取更高的超额收益，为投资者提供更好的持有体验。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，管理人内部监察稽核主要开展了如下措施：

依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章对产品的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果；通过对公司资产管理业务开展日常风险排查，对重点业务开展

专项稽核检查，尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患，并采取防范措施，督促责任部门落实整改；对风险事件和差错事件开展稽核审查，促进业务合法合规开展；实施关键岗位离任审查、人员行为监控，督促人员勤勉尽责、合规展业；配合监管检查与会计师事务所审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，管理人所管理的产品能够合法合规开展投资运作。管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用管理资产，继续加强稽核审计、合规管理和风险控制，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障产品份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括投资风险负责人、基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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，本托管人在托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本托管人依法对国海证券股份有限公司编制和披露的国海量化优选股票一年持有期集合资产管理计划 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2022)第 2266 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(以下简称“国海证券量化优选一年持有期股票型”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 8 月 23 日(集合计划合同变更生效日)至 2021 年 12 月 31 日止会计期间的利润表、所有者权益(集合计划净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附国海证券量化优选一年持有期股票型的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了国海证券量化优选一年持有期股票型 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 23 日(集合计划合同变更生效日)至 2021 年 12 月 31 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国海证券量化优选一年持有期股票型,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-

其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系国海证券量化优选一年持有期股票型管理人（以下简称“管理人”）根据《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供国海证券量化优选一年持有期股票型份额持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括国海证券量化优选一年持有期股票型 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券投资基金业协会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估国海证券量化优选一年持有期股票型的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国海证券量化优选一年持有期股票型持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国海证券量化优选一年持有期股票型不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人就国海证券量化优选一年持有期股票型的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈大愚	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号 25 层	
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	43,901,358.66
结算备付金		8,128,894.83
存出保证金		2,040,712.23
交易性金融资产	7.4.7.2	723,968,928.64
其中：股票投资		723,968,928.64
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-

应收证券清算款		4,598,068.72
应收利息	7.4.7.5	9,144.81
应收股利		-
应收申购款		84,864.17
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		782,731,972.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		4,173,944.08
应付赎回款		-
应付管理人报酬		646,344.24
应付托管费		64,634.43
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	556,697.56
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	16,460.92
负债合计		5,458,081.23
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	444,924,658.68
未分配利润	7.4.7.10	332,349,232.15
所有者权益合计		777,273,890.83
负债和所有者权益总计		782,731,972.06

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 444,924,658.68 份，其中 A 类集合计划份额净值 1.7481 元，集合计划份额总额 51,286,923.65 份；C 类集合计划份额净值 1.7468 元，集合计划份额总额 393,637,735.03 份。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 23 日（集合计划合同变更生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
一、收入		-799,037.53
1. 利息收入		117,469.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	99,974.79
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		17,494.74
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-528,392.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,187,754.88
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	659,362.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-452,613.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	64,498.13
减：二、费用		8,795,848.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,581,215.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	258,121.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,852,409.89
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		88,677.47
7. 其他费用	7.4.7.20	15,424.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,594,885.58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,594,885.58

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

本报告期：2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	61,870,332.78	43,074,399.57	104,944,732.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,594,885.58	-9,594,885.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	383,054,325.90	298,869,718.16	681,924,044.06
其中：1. 基金申购款	393,637,735.03	306,125,802.14	699,763,537.17
2. 基金赎回款	-10,583,409.13	-7,256,083.98	-17,839,493.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	444,924,658.68	332,349,232.15	777,273,890.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署：

何春梅

谭志华

韦海乐

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由国海金贝壳8号集合资产管理计划变更而来。国海金贝壳8号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划,2012年4月13日经中国证券监督管理委员会出具的证监许可[2012]516号核准设立,自2021年7月5日起开始募集,于2012年8月3日结束募集工作,并于2012年8月9日募集成立。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的规定,原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准,《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“集合计划合同”)自管理人公告的生效之日起生效,原《国海金贝壳 8 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式,存续期为自集合计划变更合同生效之日起 3 年,本集合计划变更合同生效日起 3 年后,按照中国证监会有关规定执行。本集合计划管理人为国海证券股份有限公司,托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和集合计划合同的有关规定,本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为:股票投资占集合计划资产的 80%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本集合计划于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 23 日(集合计划合同变更生效日)至 2021 年 12 月 31 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2021 年 8 月 23 日（集合计划合同变更生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。

本集合计划目前暂无金融负债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。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 该金融资产已转移，且本集合计划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；
- (3) 该金融资产已转移，虽然本集合计划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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。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，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行，且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额或对应的金额。每份集合计划份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于集合计划申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于本集合计划申购确认日或计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

截至本期末，本集合资产管理计划仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财税[2012]85号《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》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、增值税

根据财税[2016]140号文件的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财税[2017]56号文件的规定，自2018年1月1日(含)起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90号文件的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：(1)提供贷款服务，以2018

年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；(2)转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费，包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等，按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算，由管理人申报缴纳。

2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128号)文件的规定,管理人运用资产管理计划买卖股票,出股票按1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
活期存款	43,901,358.66
定期存款	-
其中:存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	43,901,358.66

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	722,903,052.27	723,968,928.64	1,065,876.37
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	722,903,052.27	723,968,928.64	1,065,876.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位:人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	

其中：国债期货投资	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-
其中：远期外汇投资	-	-	-
权益衍生工具	12,841,680.00	-	-
其中：股指期货投资	12,841,680.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-
合计	12,841,680.00	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	4,743.58
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,302.45
应收债券利息	-

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	98.78
合计	9,144.81

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	556,697.56
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	556,697.56

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	16,460.92
合计	16,460.92

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	61,870,332.78	61,870,332.78
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-10,583,409.13	-10,583,409.13
-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	51,286,923.65	51,286,923.65

国海量化优选一年持有股票 C

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	393,637,735.03	393,637,735.03
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	393,637,735.03	393,637,735.03

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	40,761,389.39	2,313,010.18	43,074,399.57
本期利润	-611,153.90	3,159,718.04	2,548,564.14
本期基金份额交易产生的变动数	-6,715,723.64	-540,360.34	-7,256,083.98
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-6,715,723.64	-540,360.34	-7,256,083.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,434,511.85	4,932,367.88	38,366,879.73

国海量化优选一年持有股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-8,531,118.53	-3,612,331.19	-12,143,449.72
本期基金份额交易产生的变动数	264,662,499.58	41,463,302.56	306,125,802.14

其中：基金申购款	264,662,499.58	41,463,302.56	306,125,802.14
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	256,131,381.05	37,850,971.37	293,982,352.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
活期存款利息收入		62,185.57
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		36,947.69
其他		841.53
合计		99,974.79

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,187,754.88
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-1,187,754.88

注：股票投资收益中扣除了增值税的影响。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
卖出股票成交总额		3,035,455,336.51
减：卖出股票成本总额		3,036,643,091.39
买卖股票差价收入		-1,187,754.88

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
证券出借差价收入	-

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-

减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应收利息总额	-
赎回差价收入	-

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
-	-
申购差价收入	-

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应收利息总额	-
资产支持证券投资收益	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
----	---------------------------------------

卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-
买卖贵金属差价收入	-

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
赎回贵金属份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回贵金属成本总额	-
赎回差价收入	-

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
-	-
申购差价收入	-

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	-

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
----	---

	-
--	---

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	659,362.84
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	659,362.84

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-761,373.15
股票投资	-761,373.15
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	308,760.00
权证投资	-
期货投资	308,760.00
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	-452,613.15

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	64,498.13
-	-
合计	64,498.13

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日

交易所市场交易费用	5,852,409.89
银行间市场交易费用	-
-	-
合计	5,852,409.89

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	10,049.32
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	467.10
账户维护费	4,907.77
合计	15,424.19

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本资产管理计划无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本资产管理计划无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国海证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
广西投资集团有限公司	基金管理人的股东
广西融桂物流集团有限公司	基金管理人的股东
广西梧州中恒集团股份有限公司	基金管理人的股东
广西投资集团金融控股有限公司	基金管理人的股东
广西桂东电力股份有限公司	基金管理人的股东
广西永盛石油化工有限公司	基金管理人的股东
广西金融投资集团有限公司	基金管理人的股东
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人的子公司
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的子公司
国海良时期货有限公司	基金管理人的子公司
国海良时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
国海创新资本投资管理有限公司	基金管理人的子公司
西安国海景恒创业投资有限公司	基金管理人的子公司
国海证券投资有限公司	基金管理人的子公司
中国工商银行股份有限公司	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国海证券	6,709,015,017.91	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
-	-	-

注：本基金本报告期未发生债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
国海证券	187,800,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例（%）
-	-	-

注：本基金本报告期未发生权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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（%）
国海证券	2,220,231.79	100.00	556,697.56	100.00

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,581,215.00
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：A类、C类份额的管理费率均为1.0%，本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.0%年费率计提，计算方法如下：

$$G = E \times \text{管理费率} \div \text{当年天数}$$

G为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，经托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

管理人业绩报酬计提方法：

1) A类份额业绩报酬计提方法：管理人对A类份额持有人每笔认/申购份额年化收益率在5%（不含）至25%（含）的部分提取20%作为业绩报酬；对A类份额持有人每笔认/申购份额年化收益率超过25%（不含）的部分提取30%作为业绩报酬；业绩报酬在集合计划分红日、集合计划份额持有人赎回确认日和集合计划终止日计提；

2) C类份额业绩报酬计提方法：在C类份额持有人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据集合计划份额持有人持有本集合计划的期间年化收益率（R），对本集合计划份额期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。

本集合计划集合计划合同自2021年8月23日起生效，无上年度同期可比数据。

本报告期内，管理人收取业绩报酬456,942.11元，业绩报酬未包含在上述管理费中。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	258,121.50

注：①本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

② 集合计划托管费计算公式为：每日应计提的集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×年托管费率÷当年天数；

③ 本集合计划集合计划合同自2021年8月23日起生效，无上年度同期可比数据。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:张)	出借期限(单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	本期 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
		国海量化优选一年持有股票 A
基金合同生效日（2021 年 8 月 23 日）持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期初持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期间申购/买入总份额	-	13,425,702.16
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	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.48%	3.02%

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国海量化优选一年持有股票 A

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
-	-	-

份额单位：份

国海量化优选一年持有股票 C

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
国海良时期货有限公司	5,585,097.47	1.4188

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	43,901,358.66	62,185.57

注：(1) 本集合计划的银行存款由集合计划托管人保管，按银行同业利率计息。本集合计划用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

(2) 本集合计划合同自 2021 年 8 月 23 日起生效，无上年度同期可比数据。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					

				数					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海量化优选一年持有股票 C									
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注	
		场内	场外						
-	-	-	-	-	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	-	-	-	-	

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：份)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票名 称	停牌日 期	停牌原 因	期末 估值单价	复牌日 期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总 额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
-	-	-	-	-	-
合计				-	-

注：本基金本期末未开展银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未开展交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未参与转融通证券出借业务。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由公司投资决策与风险控制委员会、资产管理业务发展与风险管理委员会、资管分公司产品评审与投资决策委员会、资管分公司公募产品投资决策与风险管理委员会组成的四级风险管理体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划管理的其他公开募集性质的集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本

集合计划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；集合计划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，以控制相应的信用风险。本集合计划本报告期末未持有债券投资、同业存单投资、资产支持证券投资，无重大信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本基金本期末未持有债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本基金本期末未持有债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券主要在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12（如有）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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中利率敏感性金融工具配置比例等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	43,901,358.66	-	-	-	43,901,358.66
结算备付金	8,128,894.83	-	-	-	8,128,894.83
存出保证金	2,040,712.23	-	-	-	2,040,712.23
交易性金融资产	-	-	-	723,968,928.64	723,968,928.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,144.81	9,144.81
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	84,864.17	84,864.17
应收证券清算款	-	-	-	4,598,068.72	4,598,068.72
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	54,070,965.72	-	-	728,661,006.34	782,731,972.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	646,344.24	646,344.24
应付托管费	-	-	-	64,634.43	64,634.43
应付证券清算款	-	-	-	4,173,944.08	4,173,944.08
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	556,697.56	556,697.56
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	16,460.92	16,460.92
负债总计	-	-	-	5,458,081.23	5,458,081.23
利率敏感度缺口	54,070,965.72	-	-	723,202,925.11	777,273,890.83

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	-	-

注：本集合计划本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本集合计划净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-

以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	-	-	-

注：外汇风险是指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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票等资产损失的可能性。

本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	723,968,928.64	93.14
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	723,968,928.64	93.14

7.4.13.4.3.2 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	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准下降5%	-45,213,687.03
	业绩比较基准上升5%	45,213,687.03

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-	
	-	
	-	
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2021年12月31日）
	-	-
	合计	-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于

公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

本集合计划以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

② 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 723,968,928.64 元，无属于第二层次和第三层次的余额(无上年度同期可比数据)。

③ 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。本集合计划本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	723,968,928.64	92.49
	其中：股票	723,968,928.64	92.49
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	52,030,253.49	6.65
-	-	-	-
8	其他各项资产	6,732,789.93	0.86
9	合计	782,731,972.06	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,362,495.00	0.56
B	采矿业	48,694,011.53	6.26
C	制造业	503,846,485.60	64.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,167,189.86	2.34
E	建筑业	12,375,707.40	1.59
F	批发和零售业	30,383,254.47	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	19,590,419.40	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,699,586.92	5.11
J	金融业	7,720,308.99	0.99
K	房地产业	5,832,627.47	0.75
L	租赁和商务服务业	3,249,245.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	2,653,941.31	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	3,900,632.36	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	46,560.00	0.01
P	教育	3,613,599.00	0.46
Q	卫生和社会工作	7,026,737.05	0.90
R	文化、体育和娱乐业	9,523,386.28	1.23
S	综合	3,282,741.00	0.42
	合计	723,968,928.64	93.14

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-

信息科技	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	-	-

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600884	杉杉股份	284,300	9,316,511.00	1.20
2	000988	华工科技	305,500	8,511,230.00	1.10
3	601615	明阳智能	324,400	8,466,840.00	1.09
4	600141	兴发集团	208,100	7,882,828.00	1.01
5	000960	锡业股份	400,000	7,812,000.00	1.01
6	603260	合盛硅业	55,200	7,284,744.00	0.94
7	000039	中集集团	423,700	7,270,692.00	0.94
8	601699	潞安环能	631,800	7,145,658.00	0.92
9	300037	新宙邦	61,300	6,926,900.00	0.89
10	300244	迪安诊断	195,765	6,571,831.05	0.85
11	600487	亨通光电	428,085	6,472,645.20	0.83
12	002129	中环股份	151,700	6,333,475.00	0.81
13	600183	生益科技	260,400	6,132,420.00	0.79
14	002648	卫星化学	141,400	5,660,242.00	0.73
15	002064	华峰化学	539,200	5,629,248.00	0.72
16	603986	兆易创新	30,400	5,345,840.00	0.69
17	603517	绝味食品	77,700	5,309,241.00	0.68
18	000598	兴蓉环境	824,217	5,209,051.44	0.67
19	601000	唐山港	1,852,900	5,095,475.00	0.66
20	002816	和科达	259,200	4,834,080.00	0.62
21	600089	特变电工	227,700	4,820,409.00	0.62
22	000725	京东方 A	943,200	4,763,160.00	0.61
23	600765	中航重机	93,700	4,730,913.00	0.61
24	603077	和邦生物	1,381,400	4,710,574.00	0.61
25	000733	振华科技	37,100	4,610,788.00	0.59
26	002709	天赐材料	40,100	4,597,465.00	0.59
27	601900	南方传媒	536,100	4,589,016.00	0.59
28	600586	金晶科技	493,000	4,565,180.00	0.59
29	300639	凯普生物	153,049	4,516,475.99	0.58
30	300723	一品红	125,620	4,509,758.00	0.58
31	000429	粤高速 A	607,733	4,497,224.20	0.58
32	688030	山石网科	151,199	4,484,562.34	0.58

33	688122	西部超导	46,015	4,460,694.10	0.57
34	000877	天山股份	289,400	4,430,714.00	0.57
35	002328	新朋股份	737,300	4,423,800.00	0.57
36	603610	麒盛科技	170,000	4,396,200.00	0.57
37	000949	新乡化纤	782,300	4,388,703.00	0.56
38	600711	盛屯矿业	408,700	4,385,351.00	0.56
39	300196	长海股份	249,274	4,369,773.22	0.56
40	002696	百洋股份	724,900	4,284,159.00	0.55
41	300818	耐普矿机	85,400	4,218,760.00	0.54
42	300609	汇纳科技	240,100	4,184,943.00	0.54
43	688181	八亿时空	88,145	4,178,073.00	0.54
44	002150	通润装备	655,230	4,127,949.00	0.53
45	688168	安博通	66,331	4,117,165.17	0.53
46	603599	广信股份	105,000	4,095,000.00	0.53
47	002687	乔治白	576,700	4,077,269.00	0.52
48	002286	保龄宝	300,200	4,058,704.00	0.52
49	601882	海天精工	163,300	4,044,941.00	0.52
50	002539	云图控股	304,200	4,036,734.00	0.52
51	601158	重庆水务	628,200	4,026,762.00	0.52
52	600295	鄂尔多斯	170,484	4,021,717.56	0.52
53	600581	八一钢铁	647,400	4,020,354.00	0.52
54	601001	晋控煤业	416,923	4,006,630.03	0.52
55	603829	洛凯股份	327,600	3,973,788.00	0.51
56	600256	广汇能源	606,900	3,969,126.00	0.51
57	688368	晶丰明源	12,098	3,872,569.80	0.50
58	002978	安宁股份	91,300	3,860,164.00	0.50
59	600176	中国巨石	212,014	3,858,654.80	0.50
60	002532	天山铝业	472,800	3,853,320.00	0.50
61	603889	新澳股份	622,124	3,850,947.56	0.50
62	600697	欧亚集团	306,529	3,819,351.34	0.49
63	300418	昆仑万维	163,700	3,789,655.00	0.49
64	000937	冀中能源	685,994	3,779,826.94	0.49
65	603612	索通发展	180,500	3,703,860.00	0.48
66	688357	建龙微纳	19,182	3,681,793.08	0.47
67	600455	博通股份	158,700	3,613,599.00	0.46
68	601919	中远海控	193,040	3,607,917.60	0.46
69	600596	新安股份	143,237	3,579,492.63	0.46
70	002517	恺英网络	612,900	3,567,078.00	0.46
71	600327	大东方	598,700	3,562,265.00	0.46
72	688258	卓易信息	100,571	3,548,144.88	0.46
73	600803	新奥股份	187,200	3,436,992.00	0.44
74	600248	陕西建工	707,000	3,393,600.00	0.44

75	300833	浩洋股份	41,000	3,322,230.00	0.43
76	688200	华峰测控	6,462	3,307,897.80	0.43
77	603289	泰瑞机器	332,890	3,219,046.30	0.41
78	600810	神马股份	258,000	3,212,100.00	0.41
79	300327	中颖电子	47,300	3,211,670.00	0.41
80	300897	山科智能	94,400	3,210,544.00	0.41
81	600888	新疆众和	386,600	3,197,182.00	0.41
82	600822	上海物贸	345,120	3,123,336.00	0.40
83	600867	通化东宝	281,818	3,088,725.28	0.40
84	300821	东岳硅材	168,900	3,087,492.00	0.40
85	601898	中煤能源	486,000	3,056,940.00	0.39
86	002871	伟隆股份	290,109	3,046,144.50	0.39
87	600502	安徽建工	721,460	2,994,059.00	0.39
88	000833	粤桂股份	435,500	2,900,430.00	0.37
89	002396	星网锐捷	123,000	2,899,110.00	0.37
90	003018	金富科技	261,300	2,887,365.00	0.37
91	688569	铁科轨道	142,823	2,876,455.22	0.37
92	002254	泰和新材	146,300	2,868,943.00	0.37
93	603269	海鸥股份	223,550	2,856,969.00	0.37
94	002449	国星光电	264,263	2,848,755.14	0.37
95	002835	同为股份	261,597	2,744,152.53	0.35
96	600123	兰花科创	287,100	2,690,127.00	0.35
97	000623	吉林敖东	145,500	2,687,385.00	0.35
98	600623	华谊集团	293,700	2,672,670.00	0.34
99	300727	润禾材料	100,089	2,672,376.30	0.34
100	603099	长白山	243,000	2,663,280.00	0.34
101	601339	百隆东方	451,942	2,661,938.38	0.34
102	000906	浙商中拓	232,987	2,588,485.57	0.33
103	601233	桐昆股份	119,800	2,537,364.00	0.33
104	600438	通威股份	56,200	2,526,752.00	0.33
105	603012	创力集团	408,700	2,525,766.00	0.32
106	601899	紫金矿业	259,900	2,521,030.00	0.32
107	002497	雅化集团	87,800	2,516,348.00	0.32
108	600919	江苏银行	431,500	2,515,645.00	0.32
109	688218	江苏北人	165,681	2,506,753.53	0.32
110	300535	达威股份	158,642	2,489,092.98	0.32
111	688096	京源环保	171,298	2,473,543.12	0.32
112	000519	中兵红箭	92,500	2,466,975.00	0.32
113	002765	蓝黛科技	293,600	2,466,240.00	0.32
114	600051	宁波联合	329,300	2,459,871.00	0.32
115	002829	星网宇达	62,300	2,456,489.00	0.32
116	603999	读者传媒	446,300	2,445,724.00	0.31

117	601101	昊华能源	324,940	2,404,556.00	0.31
118	000830	鲁西化工	155,200	2,368,352.00	0.30
119	688099	晶晨股份	18,111	2,358,052.20	0.30
120	601666	平煤股份	280,100	2,344,437.00	0.30
121	002732	燕塘乳业	87,200	2,340,448.00	0.30
122	600096	云天化	117,200	2,299,464.00	0.30
123	603186	华正新材	54,600	2,281,734.00	0.29
124	300662	科锐国际	36,600	2,276,886.00	0.29
125	300505	川金诺	72,600	2,224,464.00	0.29
126	000977	浪潮信息	61,000	2,185,630.00	0.28
127	300596	利安隆	48,200	2,157,432.00	0.28
128	002087	新野纺织	583,951	2,102,223.60	0.27
129	300615	欣天科技	169,900	2,069,382.00	0.27
130	300613	富瀚微	12,600	2,054,430.00	0.26
131	002416	爱施德	180,400	2,052,952.00	0.26
132	300838	浙江力诺	109,600	2,001,296.00	0.26
133	300654	世纪天鸿	205,248	1,951,908.48	0.25
134	600768	宁波富邦	204,700	1,936,462.00	0.25
135	600746	江苏索普	138,200	1,907,160.00	0.25
136	603938	三孚股份	50,400	1,854,216.00	0.24
137	002156	通富微电	94,700	1,840,021.00	0.24
138	002615	哈尔斯	324,900	1,812,942.00	0.23
139	688399	硕世生物	13,079	1,798,362.50	0.23
140	300294	博雅生物	46,700	1,790,945.00	0.23
141	600511	国药股份	56,700	1,787,751.00	0.23
142	002759	天际股份	60,200	1,763,860.00	0.23
143	300672	国科微	9,500	1,762,250.00	0.23
144	600137	浪莎股份	119,900	1,756,535.00	0.23
145	600710	苏美达	268,400	1,755,336.00	0.23
146	600360	华微电子	191,000	1,734,280.00	0.22
147	002850	科达利	10,800	1,731,672.00	0.22
148	601168	西部矿业	126,500	1,721,665.00	0.22
149	002014	永新股份	200,400	1,719,432.00	0.22
150	603203	快克股份	46,420	1,711,505.40	0.22
151	300316	晶盛机电	24,500	1,702,750.00	0.22
152	600736	苏州高新	369,780	1,697,290.20	0.22
153	600188	兖矿能源	72,100	1,696,513.00	0.22
154	300573	兴齐眼药	12,400	1,696,320.00	0.22
155	002054	德美化工	179,600	1,691,832.00	0.22
156	603283	赛腾股份	56,200	1,652,280.00	0.21
157	300696	爱乐达	31,800	1,651,692.00	0.21
158	600348	华阳股份	138,600	1,642,410.00	0.21

159	600309	万华化学	16,200	1,636,200.00	0.21
160	600116	三峡水利	139,912	1,631,373.92	0.21
161	600436	片仔癀	3,700	1,617,455.00	0.21
162	002815	崇达技术	93,200	1,570,420.00	0.20
163	600874	创业环保	216,000	1,527,120.00	0.20
164	688508	芯朋微	13,122	1,520,314.92	0.20
165	603316	诚邦股份	272,400	1,503,648.00	0.19
166	600829	人民同泰	220,501	1,481,766.72	0.19
167	002597	金禾实业	28,800	1,478,880.00	0.19
168	600808	马钢股份	396,500	1,463,085.00	0.19
169	603095	越剑智能	58,000	1,458,120.00	0.19
170	000897	津滨发展	536,000	1,457,920.00	0.19
171	002757	南兴股份	95,600	1,457,900.00	0.19
172	603966	法兰泰克	139,520	1,434,265.60	0.18
173	000063	中兴通讯	42,500	1,423,750.00	0.18
174	600232	金鹰股份	255,200	1,380,632.00	0.18
175	603067	振华股份	123,168	1,359,774.72	0.17
176	600493	凤竹纺织	222,489	1,357,182.90	0.17
177	603155	新亚强	24,700	1,336,517.00	0.17
178	600386	北巴传媒	299,263	1,334,712.98	0.17
179	600428	中远海特	264,400	1,332,576.00	0.17
180	002042	华孚时尚	290,640	1,328,224.80	0.17
181	600662	外服控股	183,900	1,316,724.00	0.17
182	002407	多氟多	29,221	1,314,652.79	0.17
183	300503	昊志机电	101,900	1,310,434.00	0.17
184	000657	中钨高新	80,500	1,294,440.00	0.17
185	600129	太极集团	57,500	1,291,450.00	0.17
186	603386	广东骏亚	60,700	1,272,272.00	0.16
187	000498	山东路桥	201,800	1,247,124.00	0.16
188	000823	超声电子	91,300	1,243,506.00	0.16
189	002867	周大生	69,800	1,241,044.00	0.16
190	603915	国茂股份	31,900	1,240,910.00	0.16
191	002061	浙江交科	218,200	1,217,556.00	0.16
192	000026	飞亚达	102,600	1,215,810.00	0.16
193	600268	国电南自	120,890	1,212,526.70	0.16
194	002748	世龙实业	107,100	1,204,875.00	0.16
195	601600	中国铝业	191,900	1,168,671.00	0.15
196	688558	国盛智科	25,709	1,162,046.80	0.15
197	601958	金钼股份	168,200	1,152,170.00	0.15
198	600177	雅戈尔	166,800	1,149,252.00	0.15
199	600894	广日股份	150,500	1,134,770.00	0.15
200	688080	映翰通	12,800	1,122,560.00	0.14

201	000677	恒天海龙	336,100	1,102,408.00	0.14
202	600426	华鲁恒升	34,600	1,082,980.00	0.14
203	600497	驰宏锌锗	216,000	1,077,840.00	0.14
204	002800	天顺股份	72,160	1,073,740.80	0.14
205	600170	上海建工	297,514	1,071,050.40	0.14
206	603043	广州酒家	44,140	1,062,008.40	0.14
207	600584	长电科技	33,600	1,042,272.00	0.13
208	603848	好太太	74,800	1,035,980.00	0.13
209	300409	道氏技术	42,600	1,033,050.00	0.13
210	688358	祥生医疗	22,661	1,032,888.38	0.13
211	688098	申联生物	93,424	1,031,400.96	0.13
212	300772	运达股份	23,400	1,029,132.00	0.13
213	300404	博济医药	73,900	1,022,037.00	0.13
214	002202	金风科技	61,700	1,016,199.00	0.13
215	002199	东晶电子	123,100	1,009,420.00	0.13
216	600446	金证股份	68,555	981,707.60	0.13
217	000885	城发环境	92,500	980,500.00	0.13
218	002105	信隆健康	96,800	967,032.00	0.12
219	300661	圣邦股份	3,100	957,900.00	0.12
220	000615	奥园美谷	88,700	956,186.00	0.12
221	601881	中国银河	85,297	954,473.43	0.12
222	688596	正帆科技	36,683	948,255.55	0.12
223	300474	景嘉微	6,100	928,420.00	0.12
224	300768	迪普科技	22,400	924,000.00	0.12
225	002636	金安国纪	60,200	906,010.00	0.12
226	603685	晨丰科技	71,689	897,546.28	0.12
227	688090	瑞松科技	27,937	889,793.45	0.11
228	002040	南京港	142,540	880,897.20	0.11
229	600779	水井坊	7,278	873,287.22	0.11
230	002117	东港股份	103,700	863,821.00	0.11
231	002401	中远海科	84,740	857,568.80	0.11
232	603677	奇精机械	67,191	850,638.06	0.11
233	600461	洪城环境	103,822	846,149.30	0.11
234	688005	容百科技	7,268	840,035.44	0.11
235	600064	南京高科	88,500	826,590.00	0.11
236	300625	三雄极光	54,200	823,298.00	0.11
237	002274	华昌化工	64,900	822,283.00	0.11
238	300775	三角防务	16,800	821,352.00	0.11
239	002649	博彦科技	70,100	818,768.00	0.11
240	600689	上海三毛	114,600	817,098.00	0.11
241	000822	山东海化	116,600	810,370.00	0.10
242	601375	中原证券	164,800	809,168.00	0.10

243	300548	博创科技	24,400	806,176.00	0.10
244	688028	沃尔德	17,388	801,934.56	0.10
245	002436	兴森科技	57,200	800,800.00	0.10
246	600278	东方创业	95,400	771,786.00	0.10
247	300750	宁德时代	1,300	764,400.00	0.10
248	300514	友讯达	59,800	757,068.00	0.10
249	000938	紫光股份	33,100	756,335.00	0.10
250	603855	华荣股份	29,877	755,290.56	0.10
251	600727	鲁北化工	70,466	732,141.74	0.09
252	000959	首钢股份	126,800	726,564.00	0.09
253	002167	东方锆业	90,100	711,790.00	0.09
254	601818	光大银行	209,000	693,880.00	0.09
255	002429	兆驰股份	138,800	674,568.00	0.09
256	002660	茂硕电源	82,800	666,540.00	0.09
257	688178	万德斯	27,553	664,578.36	0.09
258	000031	大悦城	177,999	663,936.27	0.09
259	600728	佳都科技	79,500	662,235.00	0.09
260	600219	南山铝业	139,700	657,987.00	0.08
261	605058	澳弘电子	25,800	656,868.00	0.08
262	603580	艾艾精工	54,988	645,009.24	0.08
263	601965	中国汽研	34,500	642,045.00	0.08
264	601668	中国建筑	128,400	642,000.00	0.08
265	300787	海能实业	23,700	639,900.00	0.08
266	601328	交通银行	137,900	635,719.00	0.08
267	601717	郑煤机	54,400	630,496.00	0.08
268	300722	新余国科	15,800	625,206.00	0.08
269	000701	厦门信达	113,781	615,555.21	0.08
270	002839	张家港行	106,300	612,288.00	0.08
271	002677	浙江美大	34,200	593,370.00	0.08
272	002767	先锋电子	47,080	589,912.40	0.08
273	603320	迪贝电气	43,900	579,919.00	0.07
274	000929	兰州黄河	59,001	578,799.81	0.07
275	600180	瑞茂通	80,900	577,626.00	0.07
276	600388	龙净环保	64,600	556,852.00	0.07
277	603886	元祖股份	23,100	544,005.00	0.07
278	300606	金太阳	28,700	543,004.00	0.07
279	002135	东南网架	46,900	542,164.00	0.07
280	002185	华天科技	41,900	532,549.00	0.07
281	300215	电科院	52,700	528,581.00	0.07
282	603002	宏昌电子	70,900	523,951.00	0.07
283	000898	鞍钢股份	138,900	520,875.00	0.07
284	000761	本钢板材	123,900	520,380.00	0.07

285	002818	富森美	40,400	505,404.00	0.07
286	600883	博闻科技	58,900	501,828.00	0.06
287	000544	中原环保	78,300	501,120.00	0.06
288	600308	华泰股份	80,400	497,676.00	0.06
289	000933	神火股份	53,900	489,951.00	0.06
290	600395	盘江股份	66,800	485,636.00	0.06
291	002833	弘亚数控	15,002	482,764.36	0.06
292	603527	众源新材	38,800	467,540.00	0.06
293	600838	上海九百	70,941	464,663.55	0.06
294	603109	神驰机电	16,200	461,862.00	0.06
295	688312	燕麦科技	16,673	450,171.00	0.06
296	000659	珠海中富	108,400	447,692.00	0.06
297	002460	赣锋锂业	3,100	442,835.00	0.06
298	603029	天鹅股份	30,900	441,870.00	0.06
299	002109	兴化股份	72,485	438,534.25	0.06
300	002843	泰嘉股份	42,250	430,950.00	0.06
301	605088	冠盛股份	29,600	430,088.00	0.06
302	002461	珠江啤酒	47,200	429,520.00	0.06
303	605377	华旺科技	23,500	421,590.00	0.05
304	605169	洪通燃气	24,360	409,735.20	0.05
305	603926	铁流股份	25,100	408,879.00	0.05
306	300358	楚天科技	15,500	404,085.00	0.05
307	600389	江山股份	9,800	402,976.00	0.05
308	600605	汇通能源	42,632	402,446.08	0.05
309	600057	厦门象屿	47,300	401,577.00	0.05
310	002738	中矿资源	5,700	401,052.00	0.05
311	002633	申科股份	47,100	398,937.00	0.05
312	300390	天华超净	4,900	396,900.00	0.05
313	002788	鹭燕医药	49,837	389,226.97	0.05
314	603937	丽岛新材	35,100	388,557.00	0.05
315	002494	华斯股份	87,300	384,993.00	0.05
316	000532	华金资本	32,100	382,311.00	0.05
317	603882	金城医学	3,400	378,658.00	0.05
318	002736	国信证券	32,800	376,544.00	0.05
319	600835	上海机电	23,537	374,709.04	0.05
320	300841	康华生物	1,750	372,260.00	0.05
321	688118	普元信息	15,087	368,424.54	0.05
322	603277	银都股份	19,900	368,150.00	0.05
323	603217	元利科技	7,200	364,896.00	0.05
324	603486	科沃斯	2,400	362,280.00	0.05
325	000883	湖北能源	66,900	350,556.00	0.05
326	300059	东方财富	9,400	348,834.00	0.04

327	688055	龙腾光电	50,800	347,980.00	0.04
328	300211	亿通科技	26,800	343,040.00	0.04
329	002929	润建股份	9,000	325,260.00	0.04
330	605399	晨光新材	8,100	321,651.00	0.04
331	000062	深圳华强	18,400	317,032.00	0.04
332	002337	赛象科技	71,700	315,480.00	0.04
333	600694	大商股份	16,050	313,135.50	0.04
334	002472	双环传动	11,300	311,654.00	0.04
335	300823	建科机械	13,500	308,205.00	0.04
336	603112	华翔股份	23,100	304,920.00	0.04
337	600757	长江传媒	56,900	304,415.00	0.04
338	000034	神州数码	19,000	300,770.00	0.04
339	300652	雷迪克	13,600	298,928.00	0.04
340	002977	天箭科技	3,700	296,222.00	0.04
341	603833	欧派家居	2,000	295,000.00	0.04
342	688289	圣湘生物	5,000	295,000.00	0.04
343	601166	兴业银行	15,200	289,408.00	0.04
344	300512	中亚股份	17,300	276,108.00	0.04
345	002881	美格智能	6,300	270,144.00	0.03
346	002394	联发股份	32,700	268,467.00	0.03
347	300563	神宇股份	18,500	267,880.00	0.03
348	002326	永太科技	5,200	266,292.00	0.03
349	300643	万通智控	18,600	240,126.00	0.03
350	300260	新莱应材	5,000	235,850.00	0.03
351	601077	渝农商行	61,000	234,850.00	0.03
352	601827	三峰环境	26,100	232,812.00	0.03
353	688586	江航装备	6,800	230,520.00	0.03
354	603226	菲林格尔	31,130	230,050.70	0.03
355	600368	五洲交通	56,300	229,141.00	0.03
356	300638	广和通	4,200	228,900.00	0.03
357	002111	威海广泰	18,700	228,888.00	0.03
358	000685	中山公用	25,800	228,330.00	0.03
359	300755	华致酒行	4,500	225,360.00	0.03
360	002674	兴业科技	19,971	224,274.33	0.03
361	600456	宝钛股份	3,100	222,518.00	0.03
362	002801	微光股份	10,480	214,840.00	0.03
363	688598	金博股份	600	213,024.00	0.03
364	603678	火炬电子	2,800	211,820.00	0.03
365	002758	浙农股份	16,475	204,125.25	0.03
366	688356	键凯科技	600	202,278.00	0.03
367	300223	北京君正	1,500	201,000.00	0.03
368	600713	南京医药	40,830	200,475.30	0.03

369	002927	泰永长征	16,700	198,897.00	0.03
370	600707	彩虹股份	29,100	198,462.00	0.03
371	603357	设计总院	21,300	196,386.00	0.03
372	688001	华兴源创	5,459	195,814.33	0.03
373	002206	海利得	22,000	195,360.00	0.03
374	300915	海融科技	3,300	188,793.00	0.02
375	300582	英飞特	8,700	188,181.00	0.02
376	300171	东富龙	3,700	186,998.00	0.02
377	600377	宁沪高速	21,500	185,330.00	0.02
378	002601	龙佰集团	6,300	180,117.00	0.02
379	300118	东方日升	5,500	178,585.00	0.02
380	300790	宇瞳光学	3,900	176,202.00	0.02
381	300415	伊之密	8,200	174,168.00	0.02
382	600546	山煤国际	20,900	171,589.00	0.02
383	002419	天虹股份	27,200	170,816.00	0.02
384	603399	吉翔股份	25,800	170,538.00	0.02
385	300363	博腾股份	1,900	169,955.00	0.02
386	600028	中国石化	40,000	169,200.00	0.02
387	600966	博汇纸业	16,300	168,542.00	0.02
388	300708	聚灿光电	9,000	165,690.00	0.02
389	002724	海洋王	10,100	165,135.00	0.02
390	600885	宏发股份	2,204	164,506.56	0.02
391	002842	翔鹭钨业	17,500	163,975.00	0.02
392	002022	科华生物	11,000	163,240.00	0.02
393	002756	永兴材料	1,100	162,822.00	0.02
394	601677	明泰铝业	3,600	158,724.00	0.02
395	600582	天地科技	36,200	158,556.00	0.02
396	300873	海晨股份	3,216	157,905.60	0.02
397	000913	钱江摩托	11,100	157,509.00	0.02
398	600499	科达制造	6,300	156,366.00	0.02
399	300587	天铁股份	7,800	155,766.00	0.02
400	002065	东华软件	19,800	154,440.00	0.02
401	601390	中国中铁	26,600	154,014.00	0.02
402	000902	新洋丰	9,100	153,699.00	0.02
403	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.02
404	300231	银信科技	17,100	153,216.00	0.02
405	601512	中新集团	16,900	152,945.00	0.02
406	600104	上汽集团	7,400	152,662.00	0.02
407	002761	浙江建投	20,300	152,656.00	0.02
408	600050	中国联通	38,800	152,484.00	0.02
409	000850	华茂股份	33,007	150,511.92	0.02
410	688513	苑东生物	3,200	148,480.00	0.02

411	002003	伟星股份	11,500	147,430.00	0.02
412	002158	汉钟精机	5,400	143,802.00	0.02
413	600784	鲁银投资	22,500	142,650.00	0.02
414	600273	嘉化能源	12,300	142,311.00	0.02
415	300671	富满微	1,750	141,837.50	0.02
416	002422	科伦药业	7,400	140,082.00	0.02
417	300073	当升科技	1,600	138,992.00	0.02
418	002371	北方华创	400	138,808.00	0.02
419	603803	瑞斯康达	17,300	137,016.00	0.02
420	600997	开滦股份	19,000	135,280.00	0.02
421	002611	东方精工	23,900	133,362.00	0.02
422	605358	立昂微	1,100	132,011.00	0.02
423	688085	三友医疗	4,247	131,104.89	0.02
424	000422	湖北宜化	5,900	125,729.00	0.02
425	600971	恒源煤电	18,900	122,094.00	0.02
426	603656	泰禾智能	9,800	121,912.00	0.02
427	002980	华盛昌	4,000	121,640.00	0.02
428	002952	亚世光电	9,150	121,420.50	0.02
429	300470	中密控股	2,700	120,609.00	0.02
430	002315	焦点科技	7,100	120,558.00	0.02
431	603666	亿嘉和	1,600	120,192.00	0.02
432	002180	纳思达	2,500	119,400.00	0.02
433	603181	皇马科技	6,222	119,337.96	0.02
434	003013	地铁设计	5,900	118,472.00	0.02
435	000404	长虹华意	25,200	118,188.00	0.02
436	002295	精艺股份	16,700	117,568.00	0.02
437	003028	振邦智能	2,800	117,320.00	0.02
438	600035	楚天高速	37,200	117,180.00	0.02
439	300817	双飞股份	5,420	117,017.80	0.02
440	000655	金岭矿业	14,100	116,889.00	0.02
441	300852	四会富仕	2,000	116,840.00	0.02
442	002393	力生制药	5,300	114,533.00	0.01
443	603290	斯达半导	300	114,300.00	0.01
444	002294	信立泰	4,000	109,280.00	0.01
445	300593	新雷能	2,000	108,760.00	0.01
446	000983	山西焦煤	13,000	107,510.00	0.01
447	603738	泰晶科技	1,800	106,740.00	0.01
448	603901	永创智能	6,500	104,650.00	0.01
449	688396	华润微	1,600	103,360.00	0.01
450	300319	麦捷科技	6,400	97,920.00	0.01
451	002119	康强电子	6,700	96,614.00	0.01
452	300623	捷捷微电	3,000	94,380.00	0.01

453	603993	洛阳钼业	16,800	93,744.00	0.01
454	000970	中科三环	5,800	93,090.00	0.01
455	002898	赛隆药业	8,300	86,735.00	0.01
456	002591	恒大高新	15,200	86,640.00	0.01
457	002241	歌尔股份	1,600	86,560.00	0.01
458	000100	TCL 科技	13,900	85,763.00	0.01
459	603185	上机数控	500	83,490.00	0.01
460	688360	德马科技	2,515	81,989.00	0.01
461	002841	视源股份	1,000	81,400.00	0.01
462	002008	大族激光	1,500	81,000.00	0.01
463	002128	电投能源	5,400	80,190.00	0.01
464	300692	中环环保	9,300	79,887.00	0.01
465	600097	开创国际	6,800	78,336.00	0.01
466	300027	华谊兄弟	19,780	78,328.80	0.01
467	002262	恩华药业	5,000	78,250.00	0.01
468	300036	超图软件	2,600	78,130.00	0.01
469	000651	格力电器	2,100	77,763.00	0.01
470	600007	中国国贸	5,400	77,760.00	0.01
471	300371	汇中股份	5,200	77,636.00	0.01
472	601019	山东出版	12,600	77,490.00	0.01
473	002296	辉煌科技	10,300	77,456.00	0.01
474	601678	滨化股份	9,700	77,309.00	0.01
475	688188	柏楚电子	200	77,092.00	0.01
476	000950	重药控股	15,100	77,010.00	0.01
477	600475	华光环能	6,500	76,960.00	0.01
478	603508	思维列控	3,340	76,753.20	0.01
479	002533	金杯电工	8,900	76,629.00	0.01
480	601949	中国出版	13,100	76,504.00	0.01
481	600061	国投资本	9,300	76,446.00	0.01
482	002365	永安药业	7,200	76,392.00	0.01
483	002955	鸿合科技	3,500	76,370.00	0.01
484	600528	中铁工业	9,300	76,353.00	0.01
485	300143	盈康生命	5,400	76,248.00	0.01
486	300664	鹏鹞环保	11,200	76,160.00	0.01
487	000997	新大陆	4,200	76,104.00	0.01
488	300232	洲明科技	8,500	75,990.00	0.01
489	603496	恒为科技	4,900	75,950.00	0.01
490	600621	华鑫股份	5,484	75,898.56	0.01
491	600548	深高速	7,600	75,848.00	0.01
492	002585	双星新材	2,800	75,824.00	0.01
493	603183	建研院	13,089	75,785.31	0.01
494	603298	杭叉集团	4,400	75,460.00	0.01

495	300899	上海凯鑫	2,400	74,904.00	0.01
496	002440	闰土股份	7,800	74,802.00	0.01
497	300759	康龙化成	500	70,635.00	0.01
498	688017	绿的谐波	400	69,824.00	0.01
499	002643	万润股份	2,900	68,556.00	0.01
500	300789	唐源电气	2,600	66,794.00	0.01
501	601918	新集能源	14,164	64,304.56	0.01
502	688378	奥来德	800	64,080.00	0.01
503	000893	亚钾国际	2,400	63,960.00	0.01
504	688036	传音控股	400	62,760.00	0.01
505	600705	中航产融	13,900	55,183.00	0.01
506	600854	春兰股份	8,800	54,208.00	0.01
507	605111	新洁能	300	53,430.00	0.01
508	688335	复洁环保	1,590	52,629.00	0.01
509	300736	百邦科技	4,000	46,560.00	0.01
510	002880	卫光生物	1,400	45,052.00	0.01
511	002049	紫光国微	200	45,000.00	0.01
512	300820	英杰电气	500	44,950.00	0.01
513	002712	思美传媒	8,900	44,856.00	0.01
514	688338	赛科希德	1,000	44,630.00	0.01
515	603976	正川股份	1,300	44,356.00	0.01
516	300835	龙磁科技	600	43,290.00	0.01
517	002066	瑞泰科技	3,800	42,104.00	0.01
518	688050	爱博医疗	200	42,046.00	0.01
519	002862	实丰文化	2,900	41,035.00	0.01
520	603933	睿能科技	2,700	40,986.00	0.01
521	002896	中大力德	1,700	40,664.00	0.01
522	603332	苏州龙杰	2,400	40,464.00	0.01
523	300557	理工光科	1,300	40,222.00	0.01
524	601518	吉林高速	14,800	39,960.00	0.01
525	300601	康泰生物	400	39,416.00	0.01
526	000510	新金路	6,400	37,824.00	0.00
527	002092	中泰化学	3,900	37,206.00	0.00
528	002212	天融信	1,901	36,442.17	0.00
529	000636	风华高科	1,200	35,760.00	0.00
530	000567	海德股份	2,000	35,700.00	0.00
531	688233	神工股份	400	35,280.00	0.00
532	600328	中盐化工	2,100	34,461.00	0.00
533	688278	特宝生物	1,031	30,187.68	0.00
534	600862	中航高科	800	28,608.00	0.00
535	600549	厦门钨业	1,200	27,156.00	0.00
536	600460	士兰微	500	27,100.00	0.00

537	600063	皖维高新	4,400	26,972.00	0.00
538	603588	高能环境	1,500	26,355.00	0.00
539	688388	嘉元科技	200	25,110.00	0.00
540	300113	顺网科技	1,400	22,834.00	0.00
541	300450	先导智能	300	22,311.00	0.00
542	603799	华友钴业	200	22,062.00	0.00
543	300568	星源材质	600	22,038.00	0.00
544	300476	胜宏科技	700	21,175.00	0.00
545	002183	怡亚通	3,100	20,522.00	0.00
546	300687	赛意信息	700	20,426.00	0.00
547	002391	长青股份	2,100	16,968.00	0.00
548	002043	兔宝宝	1,300	15,704.00	0.00
549	300504	天邑股份	800	15,472.00	0.00
550	300721	怡达股份	300	15,030.00	0.00
551	603613	国联股份	100	10,750.00	0.00
552	300726	宏达电子	100	10,006.00	0.00
553	601009	南京银行	700	6,272.00	0.00
554	300875	捷强装备	100	6,270.00	0.00
555	002773	康弘药业	300	6,105.00	0.00
556	002266	浙富控股	800	5,696.00	0.00
557	603456	九洲药业	100	5,626.00	0.00
558	300620	光库科技	100	5,151.00	0.00
559	002074	国轩高科	100	5,125.00	0.00
560	000423	东阿阿胶	100	4,875.00	0.00
561	603987	康德莱	200	4,346.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600141	兴发集团	23,617,492.60	3.04
2	000960	锡业股份	22,538,613.63	2.90
3	601615	明阳智能	22,464,239.44	2.89
4	601636	旗滨集团	22,393,832.00	2.88
5	600089	特变电工	19,020,518.00	2.45
6	002648	卫星化学	18,640,984.59	2.40
7	601699	潞安环能	18,601,211.00	2.39
8	002129	中环股份	16,869,968.46	2.17
9	300037	新宙邦	16,727,320.48	2.15
10	002709	天赐材料	16,525,696.00	2.13
11	000830	鲁西化工	16,211,892.00	2.09
12	601233	桐昆股份	16,146,647.73	2.08

13	000039	中集集团	15,880,781.00	2.04
14	600884	杉杉股份	15,554,695.03	2.00
15	688368	晶丰明源	15,086,884.62	1.94
16	000636	风华高科	15,059,723.02	1.94
17	603260	合盛硅业	14,900,634.00	1.92
18	600460	士兰微	14,651,737.00	1.89
19	603225	新凤鸣	14,625,294.68	1.88
20	000988	华工科技	14,533,231.00	1.87

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601636	旗滨集团	21,481,261.00	2.76
2	600141	兴发集团	19,448,114.36	2.50
3	000960	锡业股份	16,438,879.55	2.11
4	000636	风华高科	15,454,783.40	1.99
5	600460	士兰微	14,946,487.00	1.92
6	002648	卫星化学	14,265,042.01	1.84
7	601615	明阳智能	14,090,398.68	1.81
8	000830	鲁西化工	14,036,179.00	1.81
9	603225	新凤鸣	13,732,605.25	1.77
10	603486	科沃斯	13,698,957.00	1.76
11	600089	特变电工	13,386,554.00	1.72
12	002408	齐翔腾达	13,041,803.76	1.68
13	601233	桐昆股份	12,880,703.48	1.66
14	000683	远兴能源	12,715,360.22	1.64
15	002043	兔宝宝	12,527,309.04	1.61
16	600219	南山铝业	12,420,677.56	1.60
17	600426	华鲁恒升	12,119,353.26	1.56
18	688099	晶晨股份	11,939,959.07	1.54
19	002092	中泰化学	11,886,344.35	1.53
20	300223	北京君正	11,664,359.03	1.50

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,663,141,770.66
卖出股票收入（成交）总额	3,035,455,336.51

注：卖出股票收入（成交）总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2203	中证 500 股指期货 2203	9	13,150,440.00	308,760.00	-

公允价值变动总额合计（元）	308,760.00
股指期货投资本期收益（元）	-
股指期货投资本期公允价值变动（元）	308,760.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

无。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,040,712.23
2	应收证券清算款	4,598,068.72
3	应收股利	-
4	应收利息	9,144.81
5	应收申购款	84,864.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-

9	合计	6,732,789.93
---	----	--------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国海量化优选一年持有股票 A	265	193,535.56	5,328,830.07	10.39	45,958,093.58	89.61
国海量化优选一年持有股票 C	8,745	45,012.89	20,846,820.32	5.30	372,790,914.71	94.70
合计	9,010	49,381.21	26,175,650.39	5.89	418,749,008.29	94.12

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
----	------	------------	--------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	国海量化优选一年持有股票 A	1,043,176.80	0.2345
	国海量化优选一年持有股票 C	6,777,107.14	1.5232
	合计	7,820,283.94	1.7577

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国海量化优选一年持有股票 A	0
	国海量化优选一年持有股票 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国海量化优选一年持有股票 A	-
	国海量化优选一年持有股票 C	0~10
	合计	0~10

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的基金份额总量的数量区间（万份）
-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日 (2021年8月23日) 基金份额总额	61,870,332.78	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	-	393,637,735.03
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	10,583,409.13	-

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	51,286,923.65	393,637,735.03

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人的资产管理部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给上会会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 16,460.92 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。本报告期内，基金管理人或其高级管理人员、基金经理未因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人未因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国海证券	2	6,709,015,017.91	100.00%	2,220,231.79	100.00%	-
------	---	------------------	---------	--------------	---------	---

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国海证券	-	-	187,800,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年8月19日
2	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(C类份额)基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年8月19日
3	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊	2021年8月19日
4	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书	中国证监会规定网站	2021年8月19日
5	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同	中国证监会规定网站	2021年8月19日
6	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划托管协议	中国证监会规定网站	2021年8月19日
7	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年8月21日
8	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年8月23日
9	关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划2021年08月23日净值日报更正公告	中国证监会规定网站	2021年8月24日
10	国海证券股份有限公司关于增加国海证券量化优选一年持有股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年8月24日
11	国海证券股份有限公司关于增加国海证券量化优选一年持有股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022年8月26日
12	国海证券量化优选一年持有期股票型	中国证监会规定报刊及	2021年9月13日

	集合资产管理计划基金开放定期定额投资业务公告	规定网站	
13	国海证券股份有限公司关于增加国海证券量化优选一年持有股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 10 月 13 日
14	国海证券股份有限公司关于国海证券量化优选一年持有股票型集合资产管理计划参加蚂蚁基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 10 月 13 日
15	国海证券股份有限公司关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划参加天天基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 10 月 19 日
16	关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划新增京东肯特瑞为代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 10 月 20 日
17	国海证券股份有限公司关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划参加京东肯特瑞申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 10 月 20 日
18	国海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 11 月 2 日
19	国海证券股份有限公司关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划参加国海证券销售机构定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 11 月 12 日
20	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 11 月 15 日
21	关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划新增北京广源达信基金为代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 11 月 25 日
22	国海证券股份有限公司关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划参加北京广源达信基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 11 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

注：本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划托管协议；
- 4、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

13.2 存放地点

上海市黄浦区福佑路 8 号 11 楼。

13.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或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：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

国海证券股份有限公司

2022 年 3 月 31 日