

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	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 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
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 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
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 .....	54
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 .....	54

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 .....	54
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 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化多策略	
基金主代码	005443	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,762,457,185.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
下属分级基金的交易代码	005443	017874
报告期末下属分级基金的份额总额	1,195,360,727.02 份	567,096,458.00 份

注：我司经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，决定自 2023 年 2 月 22 日起对国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额类别（基金代码：017874），并对《基金合同》作相应修改。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。
业绩比较基准	60%×中证 500 指数收益率+40%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静	石立平
	联系电话	010-88005695	010-63639180
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25

		号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	北京市海淀区西三环北路 87 号 国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区太平桥大街 25 号 中国光大中心
邮政编码	100089	100033
法定代表人	邵海波	王江

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	2023 年 2 月 22 日 (基金合同生效日) -2023 年 6 月 30 日
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
本期已实现收益	49,911,871.15	-279,550.43
本期利润	23,583,566.81	-18,368,656.75
加权平均基金份额本期利润	0.0302	-0.0640
本期加权平均净值利润率	2.53%	-5.36%
本期基金份额净值增长率	5.24%	-0.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	216,685,778.98	102,994,634.05
期末可供分配基金份额利润	0.1813	0.1816
期末基金资产净值	1,414,090,384.37	670,091,092.05

期末基金份额净值	1.1830	1.1816
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	28.21%	-0.94%

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

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

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

4. 我司经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，决定自 2023 年 2 月 22 日起对国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额类别（基金代码：017874），并对《基金合同》作相应修改。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多策略 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.02%	0.74%	-0.25%	0.55%	0.27%	0.19%
过去三个月	-0.97%	0.71%	-2.45%	0.49%	1.48%	0.22%
过去六个月	5.24%	0.73%	2.66%	0.47%	2.58%	0.26%
过去一年	7.37%	0.99%	-2.30%	0.57%	9.67%	0.42%
过去三年	55.62%	1.07%	8.05%	0.71%	47.57%	0.36%
自基金合同生效起至今	28.21%	1.12%	14.71%	0.76%	13.50%	0.36%

国金量化多策略 C

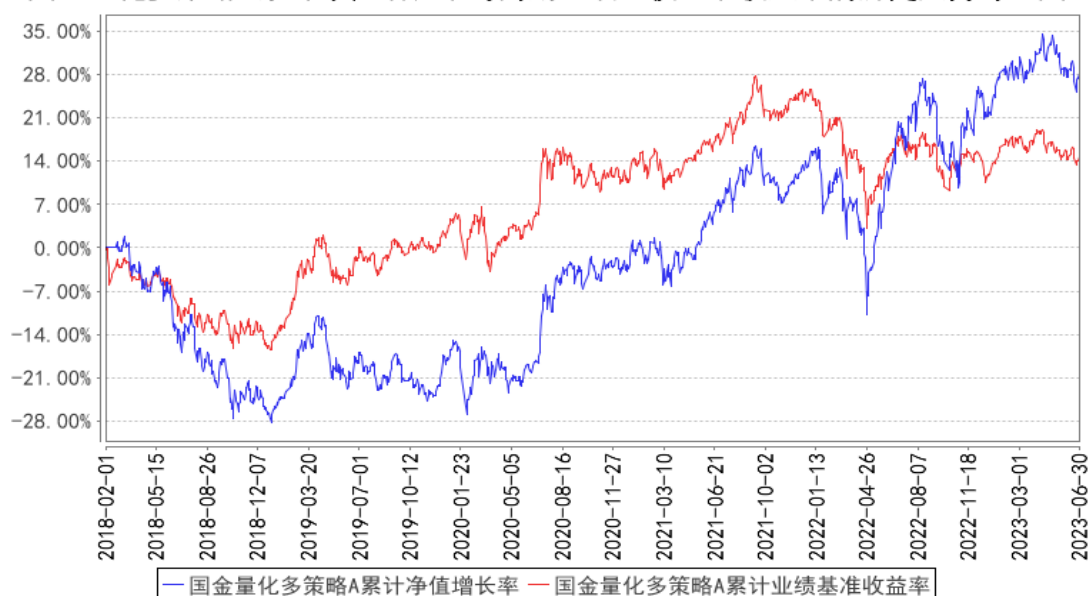
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-0.02%	0.74%	-0.25%	0.55%	0.23%	0.19%
过去三个月	-1.06%	0.71%	-2.45%	0.49%	1.39%	0.22%
自基金合同生效起至今	-0.94%	0.71%	-2.58%	0.47%	1.64%	0.24%

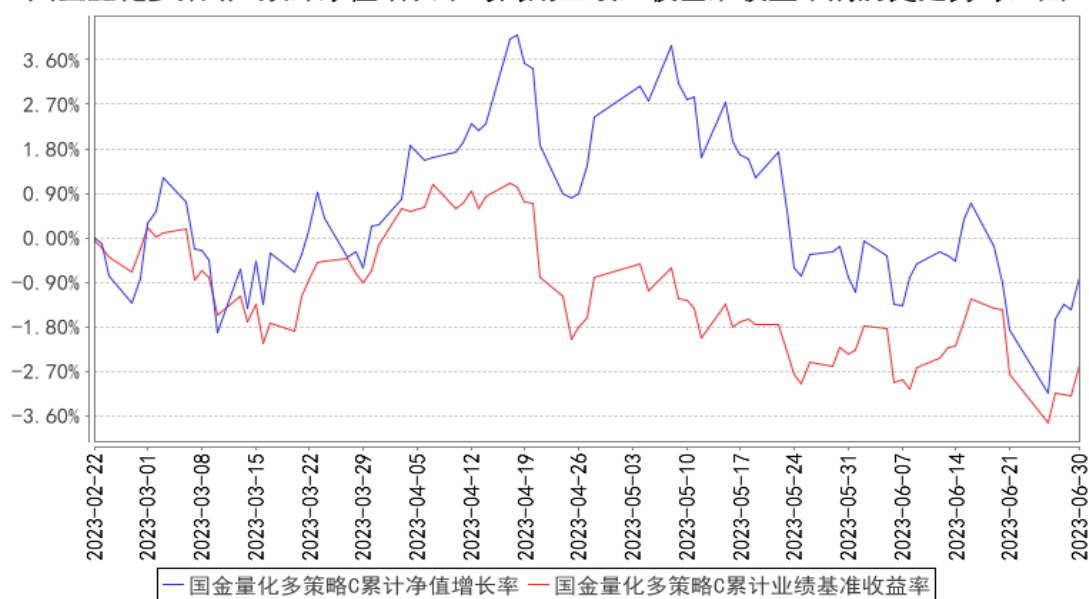
注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国金量化多策略A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国金量化多策略C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2023 年



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

### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2023 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 28 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，国金鑫盈货币市场证券投资基金，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，国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF），国金及第中短债债券型证券投资基金，国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金，国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，国金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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

马芳	本基金的基金经理	2020年9月3日	-	7年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003年7月至2016年5月历任华泰贝通网络科技有限公司担任IT事业部测试工程师，奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理，2016年5月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资事业部副总经理。
姚加红	本基金的基金经理	2023年1月5日	-	19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等职务，现任国金基金管理有限公司量化投资事业部总经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

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	2	8,313,429,535.78	2023年1月5日
	私募资产管理计划	6	1,179,084,159.05	2016年4月15日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	9,492,513,694.83	-

注：截至本报告期末，马芳不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，上半年整体看既有趋势明显、波动较大的人工智能、计算机、传媒和通信等主题或者行业赛道，也有机会分散、相对均衡的结构化机会；风格和赛道的切换相对频繁，整体市场活跃度较好，但市场波动大部分处于历史相对较低位置。基本面因子层面：市值方面大小票风格交替占优；动量今年三月底以来至报告期末该风险因子收益上涨趋势明显；盈利率风格今年以来趋势明显，延续性较强。报告期内行业涨跌幅方面，通信、传媒和计算机等行业区间涨幅较大；消费者服务、房地产和综合等行业跌幅较大。国金量化多策略持续高仓位运作，持仓分散度高，上半年超额收益特征相对稳健，主要源于收益来源的多样化和分散的持仓风格。量化策略是不断储备和迭代优化的过程，目标是获取相对持续和稳健的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 1.1830 元，累计单位净值为 1.2772 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 5.24%，同期业绩比较基准增长率为 2.66%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.1816 元，累计单位净值为 1.1816 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-0.94%，同期业绩比较基准增长率为-2.58%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预期市场风格和赛道相对频繁切换在一定时间范围内仍将是主要旋律；市场波动持续较低水

平的概率仍较大。

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

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

#### 4.7 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。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

## 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	155,284,820.67	85,418,248.42
结算备付金		0.05	2,948,461.21
存出保证金		-	220,163.13
交易性金融资产	6.4.7.2	1,931,694,475.12	480,557,280.88
其中：股票投资		1,931,694,475.12	480,557,280.88
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	-	13,865,000.00
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		54,668,375.99	15,207,181.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,141,647,671.83	598,216,334.99
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	45,341,740.58
应付赎回款		53,538,995.64	195,710.29
应付管理人报酬		2,521,260.67	545,399.75
应付托管费		420,210.12	90,899.98
应付销售服务费		236,788.73	-
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	748,940.25	1,529,748.55
负债合计		57,466,195.41	47,703,499.15
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,762,457,185.02	489,728,052.73
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	321,724,291.40	60,784,783.11
净资产合计		2,084,181,476.42	550,512,835.84
负债和净资产总计		2,141,647,671.83	598,216,334.99

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，国金量化多策略 A 基金份额净值 1.1830 元，基金份额总额 1,195,360,727.02 份；国金量化多策略 C 基金份额净值 1.1816 元，基金份额总额 567,096,458.00 份。国金量化多策略份额总额合计为 1,762,457,185.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		15,960,906.08	2,595,996.20
1. 利息收入		309,247.68	83,137.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	307,688.64	23,280.15
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		1,559.04	59,857.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		57,967,803.14	2,277,061.29
其中：股票投资收益	6.4.7.14	35,918,916.12	2,037,966.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	20,720.14
资产支持证券投资	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	22,048,887.02	218,375.06
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	-44,417,410.66	195,533.98
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	2,101,265.92	40,263.35
<b>减：二、营业总支出</b>		10,745,996.02	491,115.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,711,759.13	378,449.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,451,959.86	63,074.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	493,016.88	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,260.15	49,590.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,214,910.06	2,104,881.09
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,214,910.06	2,104,881.09
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		5,214,910.06	2,104,881.09

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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(基金净值)	489,728,052.73	-	60,784,783.11	550,512,835.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	489,728,052.73	-	60,784,783.11	550,512,835.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,272,729,132.29	-	260,939,508.29	1,533,668,640.58
(一)、综合收益总额	-	-	5,214,910.06	5,214,910.06
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,272,729,132.29	-	255,724,598.23	1,528,453,730.52
其中：1. 基金申购款	1,872,584,585.40	-	367,259,524.98	2,239,844,110.38
2. 基金赎回款	-	-	-	-711,390,379.86



	599,855,453.11		111,534,926.75	
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,762,457,185.02	-	321,724,291.40	2,084,181,476.42
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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(基金净值)	37,315,963.00	-	5,413,005.57	42,728,968.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	37,315,963.00	-	5,413,005.57	42,728,968.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	13,194,278.08	-	4,393,177.21	17,587,455.29
(一)、综合收益总额	-	-	2,104,881.09	2,104,881.09
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	13,194,278.08	-	2,288,296.12	15,482,574.20
其中：1. 基金申购款	26,869,632.31	-	4,072,304.40	30,941,936.71
2. 基金赎回款	-13,675,354.23	-	-1,784,008.28	-15,459,362.51
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净	-	-	-	-

值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	50,510,241.08	-	9,806,182.78	60,316,423.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

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

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 0-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货合约和股票期权需缴纳的交易保证金后，

保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

#### 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	17,240,671.54
等于：本金	17,231,510.53
加：应计利息	9,161.01
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	138,044,149.13
等于：本金	138,026,612.34
加：应计利息	17,536.79
减：坏账准备	-
合计	155,284,820.67

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 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,972,180,025.90	-	1,931,694,475.12	-40,485,550.78
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	1,972,180,025.90	-	1,931,694,475.12	-40,485,550.78

#### 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

注：无

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：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

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：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

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,910.10
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	139,260.15
其他	607,770.00

合计	748,940.25
----	------------

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 国金量化多策略 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	489,728,052.73	489,728,052.73
本期申购	1,007,718,405.28	1,007,718,405.28
本期赎回（以“-”号填列）	-302,085,730.99	-302,085,730.99
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	1,195,360,727.02	1,195,360,727.02

## 国金量化多策略 C

项目	本期 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	864,866,180.12	864,866,180.12
本期赎回（以“-”号填列）	-297,769,722.12	-297,769,722.12
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	567,096,458.00	567,096,458.00

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

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 国金量化多策略 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	49,064,862.27	11,719,920.84	60,784,783.11
本期利润	49,911,871.15	-26,328,304.34	23,583,566.81
本期基金份额交易产生的变动数	117,709,045.56	16,652,261.87	134,361,307.43
其中：基金申购款	162,303,080.90	29,867,826.28	192,170,907.18
基金赎回款	-44,594,035.34	-13,215,564.41	-57,809,599.75
本期已分配利润	-	-	-



本期末	216,685,778.98	2,043,878.37	218,729,657.35
-----	----------------	--------------	----------------

## 国金量化多策略 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-279,550.43	-18,089,106.32	-18,368,656.75
本期基金份额交易产生的变动数	133,197,776.44	-11,834,485.64	121,363,290.80
其中：基金申购款	202,743,330.44	-27,654,712.64	175,088,617.80
基金赎回款	-69,545,554.00	15,820,227.00	-53,725,327.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,918,226.01	-29,923,591.96	102,994,634.05

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	157,645.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	140,779.55
结算备付金利息收入	8,864.22
其他	399.18
合计	307,688.64

## 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	35,918,916.12
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	35,918,916.12

## 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	4,216,890,433.66
减：卖出股票成本总额	4,170,710,486.07
减：交易费用	10,261,031.47

买卖股票差价收入	35,918,916.12
----------	---------------

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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

注：无

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：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

注：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

注：无

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：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

注：无

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：无

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	22,048,887.02
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	22,048,887.02

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-44,417,410.66
股票投资	-44,417,410.66
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	-44,417,410.66

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,922,821.77
基金转换费收入	178,444.15
合计	2,101,265.92

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：无

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	89,260.15

## 6.4.7.24 分部报告

无

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
国金证券股份有 限公司	-	-	449,019,845.32	29.44

## 6.4.10.1.2 债券交易

注：无

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	-	-	86,208,000.00	13.43

## 6.4.10.1.4 权证交易

注：无

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	328,370.14	27.58	809,980.66	31.73

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

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,711,759.13	378,449.78
其中：支付销售机构的客户维护费	1,572,243.48	114,126.69

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,451,959.86	63,074.95

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
国金基金管理有限公司	-	240,315.26	240,315.26
国金证券股份有限公司	-	2,117.37	2,117.37
合计	-	242,432.63	242,432.63
	上年度可比期间		

获得销售服务费的各关联方 名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
合计	-	-	-

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

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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

注：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

注：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

注：无

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

注：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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司-活期存款	17,240,671.54	157,645.69	3,011,040.13	8,927.45

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
688146	中船特气	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	820	29,643.00	31,266.60	-
688249	晶合集成	2023年04月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	4,936	98,028.96	89,144.16	-
688361	中科	2023年05	6个月	新股流通	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-



	飞测	月 12 日		受限						
688443	智翔金泰	2023 年 06 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,794	67,956.72	52,905.06	-
688581	安杰思	2023 年 05 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688623	双元科技	2023 年 05 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

#### 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
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 07 月 03 日	7.40	1,031,200	7,228,700.60	7,187,464.00	-

#### 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

注：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

注：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。

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

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

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

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

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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

注：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 2023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							
银行存款	155,284,820.67	-	-	-	-	-	155,284,820.67
结算备付金	0.05	-	-	-	-	-	0.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,931,694,475.12	1,931,694,475.12
应收申购款	-	-	-	-	-	54,668,375.99	54,668,375.99
资产总计	155,284,820.72	-	-	-	-	1,986,362,851.11	2,141,647,671.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	53,538,995.64	53,538,995.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,521,260.67	2,521,260.67
应付托管费	-	-	-	-	-	420,210.12	420,210.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	236,788.73	236,788.73
其他负债	-	-	-	-	-	748,940.25	748,940.25
负债总计	-	-	-	-	-	57,466,195.41	57,466,195.41
利率敏感度缺口	155,284,820.72	-	-	-	-	1,928,896,655.70	2,084,181,476.42
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	85,418,248.42	-	-	-	-	-	85,418,248.42
结算备付金	2,948,461.21	-	-	-	-	-	2,948,461.21
存出保证金	220,163.13	-	-	-	-	-	220,163.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	480,557,280.88	480,557,280.88
买入返售金融资产	13,865,000.00	-	-	-	-	-	13,865,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	15,207,181.35	15,207,181.35
资产总计	102,451,872.76	-	-	-	-	495,764,462.23	598,216,334.99
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	45,341,740.58	45,341,740.58
应付赎回款	-	-	-	-	-	195,710.29	195,710.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	545,399.75	545,399.75
应付托管费	-	-	-	-	-	90,899.98	90,899.98
其他负债	-	-	-	-	-	1,529,748.55	1,529,748.55
负债总计	-	-	-	-	-	47,703,499.15	47,703,499.15
利率敏感度缺口	102,451,872.76	-	-	-	-	448,060,963.08	550,512,835.84

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

注：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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,931,694,475.12	92.68	480,557,280.88	87.29
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	1,931,694,475.12	92.68	480,557,280.88	87.29

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 500 指数（000905.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	+5%	80,360,949.68	22,589,067.21
	-5%	-80,360,949.68	-22,589,067.21

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,924,190,142.14	480,446,330.88
第二层次	7,187,464.00	110,950.00
第三层次	316,868.98	-
合计	1,931,694,475.12	480,557,280.88

##### 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	1,931,694,475.12	90.20
	其中：股票	1,931,694,475.12	90.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	155,284,820.72	7.25
8	其他各项资产	54,668,375.99	2.55
9	合计	2,141,647,671.83	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	-	-
B	采矿业	129,531,040.86	6.21
C	制造业	846,316,159.48	40.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	73,330,201.20	3.52
E	建筑业	59,091,073.00	2.84
F	批发和零售业	32,716,436.95	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	179,393,760.02	8.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,156,958.00	2.36
J	金融业	469,020,020.95	22.50
K	房地产业	9,796,365.00	0.47
L	租赁和商务服务业	57,146,458.80	2.74
M	科学研究和技术服务业	490,126.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	5,001,265.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	16,556,994.00	0.79
S	综合	4,123,833.00	0.20
	合计	1,931,694,475.12	92.68

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无



## 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	300433	蓝思科技	3,448,909	40,559,169.84	1.95
2	601618	中国中冶	10,173,600	40,389,192.00	1.94
3	601688	华泰证券	2,925,100	40,278,627.00	1.93
4	601012	隆基绿能	1,398,737	40,101,789.79	1.92
5	601006	大秦铁路	5,334,800	39,637,564.00	1.90
6	002600	领益智造	5,716,500	39,501,015.00	1.90
7	600999	招商证券	2,900,200	39,355,714.00	1.89
8	600019	宝钢股份	6,994,700	39,310,214.00	1.89
9	000338	潍柴动力	3,143,700	39,170,502.00	1.88
10	601318	中国平安	843,700	39,147,680.00	1.88
11	601600	中国铝业	7,128,200	39,133,818.00	1.88
12	601319	中国人保	6,682,800	39,027,552.00	1.87
13	600050	中国联通	8,041,280	38,598,144.00	1.85
14	601766	中国中车	5,925,100	38,513,150.00	1.85
15	600028	中国石化	5,970,030	37,969,390.80	1.82
16	601898	中煤能源	4,350,169	36,715,426.36	1.76
17	601888	中国中免	326,700	36,110,151.00	1.73
18	601939	建设银行	5,558,710	34,797,524.60	1.67
19	601231	环旭电子	2,316,900	34,660,824.00	1.66
20	000858	五粮液	201,300	32,926,641.00	1.58
21	600958	东方证券	3,235,349	31,382,885.30	1.51
22	600183	生益科技	2,161,200	30,689,040.00	1.47
23	600362	江西铜业	1,575,030	29,894,069.40	1.43
24	601658	邮储银行	5,846,000	28,586,940.00	1.37
25	000425	徐工机械	4,102,800	27,775,956.00	1.33
26	002461	珠江啤酒	3,034,000	26,729,540.00	1.28
27	600018	上港集团	4,814,102	25,274,035.50	1.21
28	600026	中远海能	1,970,800	24,910,912.00	1.20
29	600030	中信证券	1,253,975	24,803,625.50	1.19
30	003816	中国广核	6,495,800	20,201,938.00	0.97
31	002736	国信证券	2,309,700	20,163,681.00	0.97
32	000157	中联重科	2,958,224	19,968,012.00	0.96
33	600377	宁沪高速	1,990,100	19,562,683.00	0.94
34	600741	华域汽车	1,052,530	19,429,703.80	0.93
35	000883	湖北能源	3,917,300	17,862,888.00	0.86
36	601211	国泰君安	1,211,600	16,950,284.00	0.81
37	000776	广发证券	1,130,700	16,632,597.00	0.80
38	300251	光线传媒	2,046,600	16,556,994.00	0.79
39	601077	渝农商行	4,609,700	16,548,823.00	0.79

40	002966	苏州银行	2,435,889	15,955,072.95	0.77
41	601607	上海医药	706,575	15,834,345.75	0.76
42	600025	华能水电	2,155,100	15,365,863.00	0.74
43	600938	中国海油	838,500	15,193,620.00	0.73
44	000729	燕京啤酒	1,144,100	14,266,927.00	0.68
45	002027	分众传媒	2,056,200	14,002,722.00	0.67
46	600837	海通证券	1,499,900	13,829,078.00	0.66
47	300003	乐普医疗	606,600	13,715,226.00	0.66
48	000869	张裕 A	447,000	13,705,020.00	0.66
49	601997	贵阳银行	2,619,800	13,518,168.00	0.65
50	000877	天山股份	1,659,200	13,505,888.00	0.65
51	001965	招商公路	1,352,400	12,983,040.00	0.62
52	600031	三一重工	778,800	12,951,444.00	0.62
53	000932	华菱钢铁	2,567,976	12,249,245.52	0.59
54	601636	旗滨集团	1,375,500	11,856,810.00	0.57
55	601577	长沙银行	1,485,000	11,523,600.00	0.55
56	600219	南山铝业	3,784,200	11,428,284.00	0.55
57	600332	白云山	350,900	11,186,692.00	0.54
58	603026	胜华新材	188,600	11,174,550.00	0.54
59	603993	洛阳钼业	2,044,690	10,898,197.70	0.52
60	601108	财通证券	1,443,560	10,451,374.40	0.50
61	601018	宁波港	3,058,788	10,369,291.32	0.50
62	000887	中鼎股份	788,100	10,316,229.00	0.49
63	601669	中国电建	1,748,700	10,037,538.00	0.48
64	601901	方正证券	1,500,400	9,812,616.00	0.47
65	600160	巨化股份	699,200	9,634,976.00	0.46
66	600968	海油发展	2,918,500	8,959,795.00	0.43
67	601816	京沪高铁	1,692,400	8,902,024.00	0.43
68	000027	深圳能源	1,241,080	8,178,717.20	0.39
69	000166	申万宏源	1,580,800	7,303,296.00	0.35
70	601298	青岛港	1,031,200	7,187,464.00	0.34
71	600583	海油工程	1,195,100	6,991,335.00	0.34
72	000800	一汽解放	791,100	6,621,507.00	0.32
73	001872	招商港口	376,000	6,493,520.00	0.31
74	603077	和邦生物	2,445,600	5,942,808.00	0.29
75	000625	长安汽车	436,700	5,646,531.00	0.27
76	600704	物产中大	1,096,800	5,418,192.00	0.26
77	600801	华新水泥	430,600	5,317,910.00	0.26
78	000878	云南铜业	474,296	5,240,970.80	0.25
79	300919	中伟股份	86,900	5,235,725.00	0.25
80	600079	人福医药	191,900	5,169,786.00	0.25
81	600739	辽宁成大	392,200	5,157,430.00	0.25
82	002007	华兰生物	221,680	4,967,848.80	0.24

83	000728	国元证券	756,420	4,931,858.40	0.24
84	601233	桐昆股份	352,200	4,666,650.00	0.22
85	600985	淮北矿业	404,400	4,658,688.00	0.22
86	002085	万丰奥威	671,305	4,652,143.65	0.22
87	000060	中金岭南	976,100	4,636,475.00	0.22
88	002465	海格通信	444,700	4,598,198.00	0.22
89	600166	福田汽车	1,298,700	4,415,580.00	0.21
90	600616	金枫酒业	638,996	4,396,292.48	0.21
91	600061	国投资本	613,400	4,367,408.00	0.21
92	000062	深圳华强	381,600	4,357,872.00	0.21
93	601975	招商南油	1,510,100	4,318,886.00	0.21
94	002081	金螳螂	951,300	4,290,363.00	0.21
95	601058	赛轮轮胎	365,900	4,167,601.00	0.20
96	000967	盈峰环境	778,900	3,933,445.00	0.19
97	000636	风华高科	253,700	3,891,758.00	0.19
98	000778	新兴铸管	943,900	3,851,112.00	0.18
99	002326	永太科技	251,600	3,846,964.00	0.18
100	000401	冀东水泥	521,000	3,839,770.00	0.18
101	601966	玲珑轮胎	168,900	3,752,958.00	0.18
102	000623	吉林敖东	230,000	3,689,200.00	0.18
103	002273	水晶光电	302,800	3,615,432.00	0.17
104	603225	新凤鸣	325,500	3,596,775.00	0.17
105	000951	中国重汽	213,100	3,590,735.00	0.17
106	600369	西南证券	954,300	3,483,195.00	0.17
107	002153	石基信息	247,240	3,461,360.00	0.17
108	000783	长江证券	594,000	3,445,200.00	0.17
109	600350	山东高速	531,600	3,386,292.00	0.16
110	688148	芳源股份	277,210	3,381,962.00	0.16
111	600673	东阳光	461,000	3,323,810.00	0.16
112	601872	招商轮船	562,200	3,255,138.00	0.16
113	002468	申通快递	287,600	3,111,832.00	0.15
114	000301	东方盛虹	257,500	3,043,650.00	0.15
115	002080	中材科技	142,700	2,928,204.00	0.14
116	601198	东兴证券	360,400	2,890,408.00	0.14
117	600886	国投电力	225,400	2,851,310.00	0.14
118	000429	粤高速 A	341,700	2,678,928.00	0.13
119	601212	白银有色	983,000	2,673,760.00	0.13
120	000987	越秀资本	410,182	2,604,655.70	0.12
121	002250	联化科技	243,700	2,549,102.00	0.12
122	601808	中海油服	183,600	2,548,368.00	0.12
123	000709	河钢股份	1,116,600	2,523,516.00	0.12
124	000786	北新建材	102,200	2,504,922.00	0.12
125	601828	美凯龙	510,820	2,446,827.80	0.12

126	002563	森马服饰	367,700	2,287,094.00	0.11
127	600582	天地科技	390,600	2,277,198.00	0.11
128	600909	华安证券	457,330	2,135,731.10	0.10
129	600120	浙江东方	557,100	2,133,693.00	0.10
130	002690	美亚光电	79,000	2,034,250.00	0.10
131	601377	兴业证券	323,800	1,981,656.00	0.10
132	000582	北部湾港	258,700	1,966,120.00	0.09
133	002010	传化智联	365,300	1,943,396.00	0.09
134	601963	重庆银行	244,300	1,932,413.00	0.09
135	300428	立中集团	83,300	1,920,898.00	0.09
136	600639	浦东金桥	151,200	1,876,392.00	0.09
137	601985	中国核电	265,300	1,870,365.00	0.09
138	002152	广电运通	158,500	1,857,620.00	0.09
139	002583	海能达	316,200	1,837,122.00	0.09
140	600409	三友化工	333,000	1,814,850.00	0.09
141	603989	艾华集团	84,800	1,785,888.00	0.09
142	600007	中国国贸	93,700	1,735,324.00	0.08
143	000550	江铃汽车	123,200	1,705,088.00	0.08
144	002373	千方科技	124,600	1,699,544.00	0.08
145	600497	驰宏锌锗	335,900	1,686,218.00	0.08
146	601825	沪农商行	307,100	1,673,695.00	0.08
147	600637	东方明珠	210,300	1,644,546.00	0.08
148	002065	东华软件	231,800	1,636,508.00	0.08
149	600339	中油工程	388,400	1,580,788.00	0.08
150	600820	隧道股份	257,400	1,546,974.00	0.07
151	601158	重庆水务	278,200	1,546,792.00	0.07
152	000559	万向钱潮	279,800	1,524,910.00	0.07
153	688425	铁建重工	315,918	1,519,565.58	0.07
154	301039	中集车辆	114,500	1,514,835.00	0.07
155	600717	天津港	339,400	1,503,542.00	0.07
156	002242	九阳股份	100,400	1,500,980.00	0.07
157	600517	国网英大	260,100	1,482,570.00	0.07
158	600348	华阳股份	186,700	1,476,797.00	0.07
159	603218	日月股份	77,600	1,473,624.00	0.07
160	000831	中国稀土	49,700	1,471,120.00	0.07
161	002127	南极电商	380,200	1,456,166.00	0.07
162	000627	天茂集团	472,200	1,416,600.00	0.07
163	000629	钒钛股份	361,100	1,411,901.00	0.07
164	600420	国药现代	124,700	1,407,863.00	0.07
165	600995	南网储能	127,000	1,398,270.00	0.07
166	600320	振华重工	363,500	1,355,855.00	0.07
167	603601	再升科技	317,100	1,354,017.00	0.06
168	002416	爱施德	172,900	1,276,002.00	0.06

169	601512	中新集团	133,700	1,247,421.00	0.06
170	601598	中国外运	266,400	1,241,424.00	0.06
171	600970	中材国际	96,800	1,234,200.00	0.06
172	002413	雷科防务	232,700	1,217,021.00	0.06
173	002797	第一创业	209,800	1,200,056.00	0.06
174	000785	居然之家	311,600	1,187,196.00	0.06
175	002511	中顺洁柔	103,600	1,155,140.00	0.06
176	000517	荣安地产	375,900	1,146,495.00	0.06
177	002092	中泰化学	169,400	1,092,630.00	0.05
178	600195	中牧股份	91,700	1,071,056.00	0.05
179	601827	三峰环境	144,300	1,067,820.00	0.05
180	600064	南京高科	153,000	1,011,330.00	0.05
181	002572	索菲亚	57,900	1,008,618.00	0.05
182	003012	东鹏控股	123,200	996,688.00	0.05
183	000563	陕国投 A	325,400	992,470.00	0.05
184	600649	城投控股	251,800	989,574.00	0.05
185	600535	天士力	67,900	985,229.00	0.05
186	002237	恒邦股份	90,300	983,367.00	0.05
187	000718	苏宁环球	357,300	975,429.00	0.05
188	002212	天融信	96,700	937,990.00	0.05
189	600167	联美控股	133,800	932,586.00	0.04
190	300088	长信科技	153,800	927,414.00	0.04
191	601611	中国核建	108,200	914,290.00	0.04
192	600997	开滦股份	153,000	913,410.00	0.04
193	300219	鸿利智汇	120,900	888,615.00	0.04
194	603565	中谷物流	82,069	886,345.20	0.04
195	000598	兴蓉环境	156,700	850,881.00	0.04
196	301238	瑞泰新材	39,800	809,532.00	0.04
197	000898	鞍钢股份	290,800	808,424.00	0.04
198	002635	安洁科技	58,000	800,400.00	0.04
199	600770	综艺股份	142,100	800,023.00	0.04
200	002110	三钢闽光	187,600	791,672.00	0.04
201	002139	拓邦股份	56,500	737,325.00	0.04
202	600271	航天信息	51,800	709,142.00	0.03
203	601880	辽港股份	445,700	695,292.00	0.03
204	600967	内蒙一机	67,900	685,790.00	0.03
205	600990	四创电子	21,600	683,424.00	0.03
206	600008	首创环保	237,200	683,136.00	0.03
207	600352	浙江龙盛	72,200	675,070.00	0.03
208	002106	莱宝高科	79,100	672,350.00	0.03
209	600531	豫光金铅	101,300	638,190.00	0.03
210	000750	国海证券	189,600	635,160.00	0.03
211	000959	首钢股份	179,800	629,300.00	0.03

212	600073	上海梅林	84,300	615,390.00	0.03
213	000537	广宇发展	52,200	609,174.00	0.03
214	000828	东莞控股	66,100	604,815.00	0.03
215	000030	富奥股份	119,580	602,683.20	0.03
216	603919	金徽酒	25,200	591,696.00	0.03
217	600917	重庆燃气	85,100	578,680.00	0.03
218	002042	华孚时尚	170,400	535,056.00	0.03
219	002376	新北洋	65,900	531,813.00	0.03
220	301002	崧盛股份	25,690	530,241.60	0.03
221	600623	华谊集团	84,600	527,058.00	0.03
222	600864	哈投股份	102,600	524,286.00	0.03
223	603378	亚士创能	57,200	521,092.00	0.03
224	600876	凯盛新能	32,300	515,508.00	0.02
225	300098	高新兴	140,900	514,285.00	0.02
226	600177	雅戈尔	80,900	510,479.00	0.02
227	002678	珠江钢琴	88,800	508,824.00	0.02
228	601969	海南矿业	76,700	504,686.00	0.02
229	300055	万邦达	69,300	498,960.00	0.02
230	002303	美盈森	143,600	463,828.00	0.02
231	001696	宗申动力	65,000	460,200.00	0.02
232	300337	银邦股份	68,700	458,229.00	0.02
233	000930	中粮科技	56,200	455,220.00	0.02
234	300932	三友联众	29,300	452,392.00	0.02
235	300319	麦捷科技	52,700	451,112.00	0.02
236	601003	柳钢股份	106,400	429,856.00	0.02
237	600125	铁龙物流	70,300	424,612.00	0.02
238	300767	震安科技	16,200	410,832.00	0.02
239	002798	帝欧家居	59,700	404,169.00	0.02
240	600742	一汽富维	48,156	394,397.64	0.02
241	603960	克来机电	20,600	384,190.00	0.02
242	002673	西部证券	58,900	374,015.00	0.02
243	300690	双一科技	23,200	370,504.00	0.02
244	002539	云图控股	41,200	369,976.00	0.02
245	002255	海陆重工	60,900	369,054.00	0.02
246	600635	大众公用	110,800	367,856.00	0.02
247	603166	福达股份	54,100	364,634.00	0.02
248	600016	民生银行	97,000	363,750.00	0.02
249	002233	塔牌集团	47,100	363,612.00	0.02
250	002662	京威股份	107,300	357,309.00	0.02
251	603626	科森科技	50,700	355,914.00	0.02
252	300758	七彩化学	35,600	353,508.00	0.02
253	002111	威海广泰	36,900	352,026.00	0.02
254	002810	山东赫达	19,300	347,400.00	0.02

255	301040	中环海陆	16,900	347,295.00	0.02
256	300241	瑞丰光电	69,000	345,690.00	0.02
257	002842	翔鹭钨业	40,500	345,465.00	0.02
258	300610	晨化股份	29,600	343,656.00	0.02
259	600628	新世界	46,900	339,087.00	0.02
260	300531	优博讯	23,900	337,946.00	0.02
261	002449	国星光电	38,000	337,820.00	0.02
262	603579	荣泰健康	16,100	336,812.00	0.02
263	300941	创识科技	15,900	323,406.00	0.02
264	002481	双塔食品	72,100	321,566.00	0.02
265	002645	华宏科技	26,200	321,212.00	0.02
266	000407	胜利股份	87,400	319,010.00	0.02
267	603661	恒林股份	9,500	315,020.00	0.02
268	000655	金岭矿业	49,100	309,821.00	0.01
269	000417	合肥百货	66,100	309,348.00	0.01
270	002479	富春环保	65,600	305,696.00	0.01
271	600299	安迪苏	36,500	290,905.00	0.01
272	600433	冠豪高新	84,600	288,486.00	0.01
273	600528	中铁工业	27,500	271,700.00	0.01
274	601608	中信重工	63,400	266,914.00	0.01
275	603776	永安行	17,600	253,440.00	0.01
276	300951	博硕科技	4,100	223,983.00	0.01
277	002631	德尔未来	41,200	222,480.00	0.01
278	002500	山西证券	38,500	214,830.00	0.01
279	300752	隆利科技	12,500	212,875.00	0.01
280	300352	北信源	41,100	207,144.00	0.01
281	605196	华通线缆	28,900	205,768.00	0.01
282	600708	光明地产	95,900	205,226.00	0.01
283	002084	海鸥住工	50,500	198,970.00	0.01
284	003013	地铁设计	9,400	171,550.00	0.01
285	600908	无锡银行	31,200	167,232.00	0.01
286	601686	友发集团	24,200	165,528.00	0.01
287	600284	浦东建设	21,300	130,356.00	0.01
288	002745	木林森	11,500	105,800.00	0.01
289	000859	国风新材	19,300	95,535.00	0.00
290	600894	广日股份	12,600	94,878.00	0.00
291	688249	晶合集成	4,936	89,144.16	0.00
292	688026	洁特生物	4,498	82,178.46	0.00
293	301139	元道通信	2,700	78,003.00	0.00
294	300889	爱克股份	5,200	77,844.00	0.00
295	603158	腾龙股份	9,700	74,302.00	0.00
296	605166	聚合顺	7,800	72,696.00	0.00
297	603183	建研院	13,800	65,136.00	0.00

298	300608	思特奇	5,800	56,028.00	0.00
299	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
300	688443	智翔金泰	1,794	52,905.06	0.00
301	603098	森特股份	2,400	49,200.00	0.00
302	000913	钱江摩托	2,400	43,752.00	0.00
303	601958	金钼股份	3,400	37,910.00	0.00
304	688146	中船特气	820	31,266.60	0.00
305	603733	仙鹤股份	1,300	27,105.00	0.00
306	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
307	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
308	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
309	000791	甘肃能源	3,100	16,213.00	0.00
310	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
311	600755	厦门国贸	1,900	14,706.00	0.00
312	603978	深圳新星	800	14,200.00	0.00
313	002073	软控股份	2,100	13,902.00	0.00
314	002391	长青股份	1,900	13,053.00	0.00
315	603937	丽岛新材	1,000	11,590.00	0.00
316	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
317	600933	爱柯迪	100	2,329.00	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	000333	美的集团	78,142,249.09	14.19
2	600030	中信证券	75,840,437.91	13.78
3	601012	隆基绿能	70,209,146.88	12.75
4	601318	中国平安	61,285,324.35	11.13
5	601319	中国人保	59,691,063.00	10.84
6	601888	中国中免	57,224,374.36	10.39
7	600019	宝钢股份	56,460,763.32	10.26
8	601688	华泰证券	54,186,583.00	9.84
9	600028	中国石化	52,912,940.80	9.61
10	300433	蓝思科技	50,856,021.90	9.24
11	600050	中国联通	49,742,654.60	9.04
12	002600	领益智造	49,060,003.00	8.91
13	601766	中国中车	46,912,484.00	8.52
14	601658	邮储银行	46,896,911.65	8.52
15	601600	中国铝业	46,643,569.00	8.47
16	000338	潍柴动力	45,304,223.48	8.23
17	601898	中煤能源	44,678,582.52	8.12
18	600999	招商证券	44,628,280.97	8.11



19	000729	燕京啤酒	43,875,526.96	7.97
20	601231	环旭电子	43,867,231.32	7.97
21	601088	中国神华	43,326,958.99	7.87
22	600183	生益科技	42,484,879.03	7.72
23	000776	广发证券	42,440,153.00	7.71
24	601006	大秦铁路	41,814,160.38	7.60
25	000858	五粮液	41,330,655.00	7.51
26	601607	上海医药	40,530,110.17	7.36
27	601618	中国中冶	39,472,350.00	7.17
28	601939	建设银行	39,058,795.70	7.09
29	002384	东山精密	36,346,653.00	6.60
30	600938	中国海油	35,924,801.70	6.53
31	600036	招商银行	34,980,333.00	6.35
32	601615	明阳智能	34,695,503.99	6.30
33	603993	洛阳钼业	34,590,444.00	6.28
34	601669	中国电建	34,314,258.00	6.23
35	600958	东方证券	33,924,234.81	6.16
36	000001	平安银行	33,916,317.57	6.16
37	601166	兴业银行	33,872,456.60	6.15
38	000425	徐工机械	33,716,284.00	6.12
39	000725	京东方 A	33,647,277.00	6.11
40	601668	中国建筑	33,312,488.00	6.05
41	601077	渝农商行	33,110,933.00	6.01
42	002736	国信证券	32,459,219.00	5.90
43	600362	江西铜业	31,634,219.28	5.75
44	600026	中远海能	30,829,831.98	5.60
45	601211	国泰君安	30,134,019.00	5.47
46	600018	上港集团	29,811,113.74	5.42
47	300003	乐普医疗	28,803,418.00	5.23
48	601398	工商银行	28,205,843.35	5.12
49	000625	长安汽车	26,989,723.00	4.90
50	002461	珠江啤酒	26,869,550.61	4.88
51	002709	天赐材料	26,833,209.00	4.87
52	600837	海通证券	25,183,357.00	4.57
53	600377	宁沪高速	25,078,153.00	4.56
54	601899	紫金矿业	24,675,608.90	4.48
55	002352	顺丰控股	24,592,711.00	4.47
56	600741	华域汽车	24,097,087.40	4.38
57	603259	药明康德	23,862,418.47	4.33
58	600332	白云山	23,411,025.97	4.25
59	601066	中信建投	22,054,069.00	4.01
60	600160	巨化股份	21,483,472.40	3.90
61	000166	申万宏源	20,823,127.00	3.78

62	300014	亿纬锂能	20,739,501.00	3.77
63	600023	浙能电力	20,643,818.00	3.75
64	600031	三一重工	20,643,698.00	3.75
65	000002	万科A	20,448,358.85	3.71
66	300750	宁德时代	19,919,200.00	3.62
67	600132	重庆啤酒	19,856,493.99	3.61
68	600219	南山铝业	19,777,425.00	3.59
69	003816	中国广核	19,682,030.00	3.58
70	601601	中国太保	19,470,136.00	3.54
71	600588	用友网络	19,334,586.27	3.51
72	601901	方正证券	19,146,425.33	3.48
73	000157	中联重科	19,145,479.56	3.48
74	000883	湖北能源	19,076,544.00	3.47
75	601108	财通证券	19,011,188.50	3.45
76	002938	鹏鼎控股	18,997,634.00	3.45
77	600519	贵州茅台	18,977,917.00	3.45
78	002594	比亚迪	18,866,768.50	3.43
79	600900	长江电力	18,743,532.00	3.40
80	601988	中国银行	18,512,786.00	3.36
81	603392	万泰生物	18,461,406.49	3.35
82	000301	东方盛虹	18,213,683.32	3.31
83	000651	格力电器	18,030,996.00	3.28
84	601238	广汽集团	17,747,254.00	3.22
85	600803	新奥股份	17,613,261.20	3.20
86	603026	胜华新材	17,518,742.18	3.18
87	601857	中国石油	17,473,282.84	3.17
88	600025	华能水电	17,420,462.05	3.16
89	601995	中金公司	17,371,654.00	3.16
90	600968	海油发展	17,288,494.00	3.14
91	002966	苏州银行	17,264,332.55	3.14
92	000932	华菱钢铁	17,231,659.04	3.13
93	601018	宁波港	16,965,470.20	3.08
94	601577	长沙银行	16,927,877.10	3.07
95	600886	国投电力	16,853,050.00	3.06
96	300251	光线传媒	16,758,571.00	3.04
97	000877	天山股份	16,753,661.00	3.04
98	002466	天齐锂业	16,677,507.60	3.03
99	603185	上机数控	16,623,057.62	3.02
100	600690	海尔智家	16,609,279.32	3.02
101	600703	三安光电	16,472,224.00	2.99
102	000100	TCL科技	16,232,763.00	2.95
103	002241	歌尔股份	16,134,809.00	2.93
104	603806	福斯特	16,107,827.00	2.93

105	601989	中国重工	15,747,610.00	2.86
106	001872	招商港口	15,462,859.31	2.81
107	600585	海螺水泥	15,328,133.66	2.78
108	601816	京沪高铁	15,283,237.00	2.78
109	601186	中国铁建	15,248,378.00	2.77
110	002129	TCL 中环	15,047,079.00	2.73
111	601997	贵阳银行	14,928,050.00	2.71
112	601288	农业银行	14,788,166.00	2.69
113	002459	晶澳科技	14,650,575.94	2.66
114	002304	洋河股份	14,235,207.00	2.59
115	002027	分众传媒	14,116,367.00	2.56
116	600027	华电国际	13,962,653.40	2.54
117	001979	招商蛇口	13,609,539.00	2.47
118	600059	古越龙山	13,437,141.00	2.44
119	000027	深圳能源	13,067,837.40	2.37
120	600029	南方航空	12,834,311.00	2.33
121	000869	张裕 A	12,797,449.00	2.32
122	601916	浙商银行	12,678,425.00	2.30
123	300769	德方纳米	12,607,861.00	2.29
124	601880	辽港股份	12,573,746.00	2.28
125	600985	淮北矿业	12,395,846.00	2.25
126	600039	四川路桥	12,336,385.00	2.24
127	002460	赣锋锂业	12,264,071.34	2.23
128	600760	中航沈飞	12,204,008.40	2.22
129	001965	招商公路	12,165,014.41	2.21
130	601298	青岛港	12,132,272.00	2.20
131	601169	北京银行	12,109,796.00	2.20
132	601636	旗滨集团	11,832,440.00	2.15
133	603077	和邦生物	11,667,898.00	2.12
134	600016	民生银行	11,613,472.00	2.11
135	600438	通威股份	11,598,504.00	2.11
136	600600	青岛啤酒	11,535,548.00	2.10
137	600309	万华化学	11,491,327.00	2.09
138	600583	海油工程	11,319,704.31	2.06
139	000887	中鼎股份	11,121,720.00	2.02
140	600795	国电电力	11,049,128.97	2.01

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	000333	美的集团	86,256,433.36	15.67
2	600030	中信证券	54,011,131.15	9.81

3	601668	中国建筑	45,889,947.60	8.34
4	601088	中国神华	44,041,412.00	8.00
5	600036	招商银行	43,188,239.00	7.85
6	000001	平安银行	41,077,287.59	7.46
7	601166	兴业银行	40,478,173.00	7.35
8	002384	东山精密	39,907,811.00	7.25
9	601615	明阳智能	34,695,805.59	6.30
10	601398	工商银行	34,265,862.60	6.22
11	000725	京东方 A	31,861,000.00	5.79
12	601318	中国平安	30,923,828.49	5.62
13	000002	万科 A	30,265,064.00	5.50
14	000729	燕京啤酒	30,006,518.99	5.45
15	300750	宁德时代	29,298,144.48	5.32
16	601601	中国太保	29,219,457.51	5.31
17	000776	广发证券	28,281,652.00	5.14
18	601012	隆基绿能	27,715,686.12	5.03
19	601319	中国人保	27,647,243.00	5.02
20	600519	贵州茅台	27,111,689.80	4.92
21	002709	天赐材料	26,423,788.43	4.80
22	002352	顺丰控股	25,474,026.98	4.63
23	601607	上海医药	24,607,854.00	4.47
24	601857	中国石油	23,949,259.00	4.35
25	603259	药明康德	23,404,712.00	4.25
26	600938	中国海油	22,724,581.25	4.13
27	601995	中金公司	22,633,497.75	4.11
28	000625	长安汽车	22,551,037.87	4.10
29	600585	海螺水泥	22,534,553.00	4.09
30	600438	通威股份	22,478,978.32	4.08
31	601066	中信建投	22,207,443.06	4.03
32	603993	洛阳钼业	21,896,198.21	3.98
33	600023	浙能电力	21,783,887.70	3.96
34	601658	邮储银行	21,440,021.00	3.89
35	002938	鹏鼎控股	21,105,066.00	3.83
36	601899	紫金矿业	20,936,807.05	3.80
37	002304	洋河股份	20,925,856.85	3.80
38	600132	重庆啤酒	20,761,417.02	3.77
39	600588	用友网络	20,413,606.00	3.71
40	600600	青岛啤酒	20,402,149.44	3.71
41	601669	中国电建	20,372,063.00	3.70
42	600900	长江电力	20,336,247.00	3.69
43	000651	格力电器	20,117,675.00	3.65
44	600028	中国石化	19,600,589.05	3.56
45	601988	中国银行	19,355,699.00	3.52

46	300014	亿纬锂能	18,470,053.75	3.36
47	300769	德方纳米	18,294,598.00	3.32
48	002594	比亚迪	18,158,072.00	3.30
49	600019	宝钢股份	18,106,829.00	3.29
50	601688	华泰证券	17,886,977.00	3.25
51	601288	农业银行	17,785,679.00	3.23
52	601186	中国铁建	17,784,419.00	3.23
53	601989	中国重工	17,581,922.00	3.19
54	601888	中国中免	17,286,988.00	3.14
55	600703	三安光电	17,101,788.00	3.11
56	300498	温氏股份	16,950,221.19	3.08
57	002241	歌尔股份	16,922,001.00	3.07
58	601138	工业富联	16,791,077.00	3.05
59	601238	广汽集团	16,736,224.20	3.04
60	603392	万泰生物	16,636,528.40	3.02
61	600803	新奥股份	16,579,481.00	3.01
62	603806	福斯特	16,417,194.39	2.98
63	000166	申万宏源	15,771,523.00	2.86
64	600690	海尔智家	15,648,151.00	2.84
65	603185	上机数控	15,458,007.30	2.81
66	600031	三一重工	15,413,747.00	2.80
67	002466	天齐锂业	15,019,258.08	2.73
68	600886	国投电力	15,010,122.80	2.73
69	002459	晶澳科技	14,966,688.00	2.72
70	600027	华电国际	14,869,910.58	2.70
71	000100	TCL 科技	14,830,500.10	2.69
72	300003	乐普医疗	14,518,552.00	2.64
73	600029	南方航空	14,429,823.99	2.62
74	600059	古越龙山	14,263,201.80	2.59
75	000301	东方盛虹	14,223,862.00	2.58
76	002129	TCL 中环	13,959,310.21	2.54
77	000858	五粮液	13,795,477.00	2.51
78	000568	泸州老窖	13,505,401.11	2.45
79	601077	渝农商行	13,480,791.00	2.45
80	002600	领益智造	13,163,810.00	2.39
81	300433	蓝思科技	13,086,398.00	2.38
82	600276	恒瑞医药	13,073,936.64	2.37
83	002475	立讯精密	12,971,075.00	2.36
84	001979	招商蛇口	12,745,768.00	2.32
85	600104	上汽集团	12,444,965.00	2.26
86	002460	赣锋锂业	12,313,674.08	2.24
87	601916	浙商银行	12,294,520.00	2.23
88	600160	巨化股份	12,217,343.00	2.22

89	601628	中国人寿	12,106,662.00	2.20
90	601169	北京银行	12,050,874.00	2.19
91	601919	中远海控	12,010,131.00	2.18
92	600837	海通证券	11,976,312.00	2.18
93	600760	中航沈飞	11,958,980.00	2.17
94	600332	白云山	11,902,214.10	2.16
95	600039	四川路桥	11,897,111.53	2.16
96	000860	顺鑫农业	11,728,530.00	2.13
97	603288	海天味业	11,702,594.00	2.13
98	603444	吉比特	11,670,782.00	2.12
99	601231	环旭电子	11,388,794.68	2.07
100	600809	山西汾酒	11,299,673.00	2.05
101	600050	中国联通	11,296,107.00	2.05
102	601880	辽港股份	11,258,049.14	2.05
103	600016	民生银行	11,068,740.00	2.01
104	601211	国泰君安	11,062,800.00	2.01

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	5,666,265,090.97
卖出股票收入（成交）总额	4,216,890,433.66

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：无

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未投资股指期货。

## 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

本基金报告期内未投资国债期货。

### 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，大秦铁路股份有限公司于 2022 年 11 月 02 日受到西安铁路监督管理局给予罚款 3 万元的行政处罚，于 2022 年 07 月 26 日受到西安铁路监督管理局给予罚款 3 万元的行政处罚；招商证券股份有限公司于 2022 年 09 月 20 日受到中国证监会给予没收业务收入 3,150 万元、并处以 3,150 万元罚款的行政处罚；中国平安保险(集团)股份有限公司于 2022 年 08 月 22 日受到国家外汇管理局给予责令改正、警告、处罚款 30 万元的行政处罚。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	54,668,375.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,668,375.99

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
国金量化 多策略 A	64,154	18,632.68	912,867,726.42	76.37	282,493,000.60	23.63
国金量化 多策略 C	5,058	112,118.71	399,405,570.11	70.43	167,690,887.89	29.57
合计	69,212	25,464.62	1,312,273,296.53	74.46	450,183,888.49	25.54

## 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	国金量化多策略 A	1,698,424.48	0.1421
	国金量化多策略 C	25,318.60	0.0045
	合计	1,723,743.08	0.0978

## 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、 基金投资和部门负 责人持有本开放式基金	国金量化多策略 A	50~100
	国金量化多策略 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本 开放式基金	国金量化多策略 A	0~10
	国金量化多策略 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
----	-----------	-----------



基金合同生效日 (2018年2月1日)基金份额总额	425,485,490.92	-
本报告期期初基金份额总额	489,728,052.73	-
本报告期基金总申购份额	1,007,718,405.28	864,866,180.12
减:本报告期基金总赎回份额	302,085,730.99	297,769,722.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,195,360,727.02	567,096,458.00

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

原督察长张丽女士自 2023 年 6 月 14 日起由于个人原因离任基金管理人督察长职务,自 2023 年 6 月 14 日至 2023 年 7 月 23 日由公司总经理邵海波先生代任督察长职务,张静女士自 2023 年 7 月 24 日起担任基金管理人督察长职务。

除上述人事调整以外,本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

报告期内未有投资策略改变。

### 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:本报告期内,本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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 (%)	
恒泰证券	3	9,729,212,890.71	98.47	5,156,259.39	97.91	-
东方财富证券	2	142,127,263.95	1.44	103,937.58	1.97	-
国信证券	1	8,565,000.71	0.09	6,263.59	0.12	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本基金本报告期新增东方财富证券 2 个交易单元。

### 10.7.2 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 (%)
恒泰证券	-	-	2,000.00	0.04	-	-
东方财富证券	-	-	2,400,000.00	49.60	-	-
国信证券	-	-	2,437,000.00	50.36	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证	-	-	-	-	-	-

券						
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 05 日
2	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 06 日
3	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 06 日
4	《国金基金管理有限公司关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 11 日
5	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 14 日
6	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金证券交易模式转换完成的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 14 日
7	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 14 日
8	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
9	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 02 月 22 日
10	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 02 月 22 日

11	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额及基金合同修改的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 02 月 22 日
12	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 02 月 23 日
13	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 A 类份额）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	2023 年 02 月 23 日
14	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 C 类份额）基金产品资料概要》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 02 月 23 日
15	《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 10 日
16	《国金基金管理有限公司关于面向特定投资者（养老金客户）通过直销柜台申购（含转换转入）旗下基金实施费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 29 日
17	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 30 日
18	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 31 日
19	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
20	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 16 日

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

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	1	2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 1 日； 2023 年 6 月	165,892,861.45	234,700,976.01	125,292,084.83	275,301,752.63	15.62

		12 日-2023 年 6 月 15 日; 2023 年 6 月 19 日-2023 年 6 月 26 日					
	2	2023 年 1 月 10 日-2023 年 2 月 8 日; 2023 年 5 月 18 日-2023 年 5 月 23 日; 2023 年 5 月 25 日-2023 年 5 月 25 日	53,832,266.12	299,596,125.64	48,658,013.83	304,770,377.93	17.29
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20% 的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。</p>							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 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

2023年8月30日