

# 国金量化多因子股票型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	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 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	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 净资产变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
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 .....	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
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 .....	74
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 .....	75

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 .....	75
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 .....	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75
7.12 投资组合报告附注 .....	75
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
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 .....	77
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>78</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
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 .....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
10.4 基金投资策略的改变 .....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
10.8 其他重大事件 .....	82
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>83</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 .....	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	83
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>83</b>
12.1 备查文件目录 .....	83
12.2 存放地点 .....	83
12.3 查阅方式 .....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	国金量化多因子	
基金主代码	006195	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 31 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,180,193,969.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
下属分级基金的交易代码	006195	016858
报告期末下属分级基金的份额总额	1,487,991,013.73 份	692,202,955.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、量化选股模型、债券等固定收益类资产投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略。</p> <p>本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。量化选股模型包括，多因子选股策略、统计套利策略、事件驱动套利策略、投资组合优化。</p> <p>本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。</p>
业绩比较基准	85%×中证 500 指数收益率+15%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静	许俊
	联系电话	010-88005695	010-66596688
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	4000-2000-18	95566
传真	010-88005666	010-66594942
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100020	100818
法定代表人	邵海波	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告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住所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
本期已实现收益	-1,118,784,551.82	-603,353,418.24
本期利润	-1,091,183,821.94	-714,663,670.39
加权平均基金份额 本期利润	-0.5496	-0.6520
本期加权平均净 值利润率	-29.91%	-35.47%
本期基金份额净 值增长率	-16.60%	-16.77%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	847,830,940.14	357,985,849.61

期末可供分配基金份额利润	0.5698	0.5172
期末基金资产净值	2,600,144,637.57	1,201,673,623.51
期末基金份额净值	1.7474	1.7360
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	74.74%	-0.09%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多因子 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	-4.53%	0.98%	-5.74%	0.81%	1.21%	0.17%
过去三个月	-4.07%	1.25%	-5.23%	0.97%	1.16%	0.28%
过去六个月	-16.60%	2.08%	-6.90%	1.36%	-9.70%	0.72%
过去一年	-15.84%	1.56%	-14.14%	1.08%	-1.70%	0.48%
过去三年	15.47%	1.33%	-21.45%	1.01%	36.92%	0.32%
自基金合同生效起至今	74.74%	1.25%	21.57%	1.12%	53.17%	0.13%

国金量化多因子 C

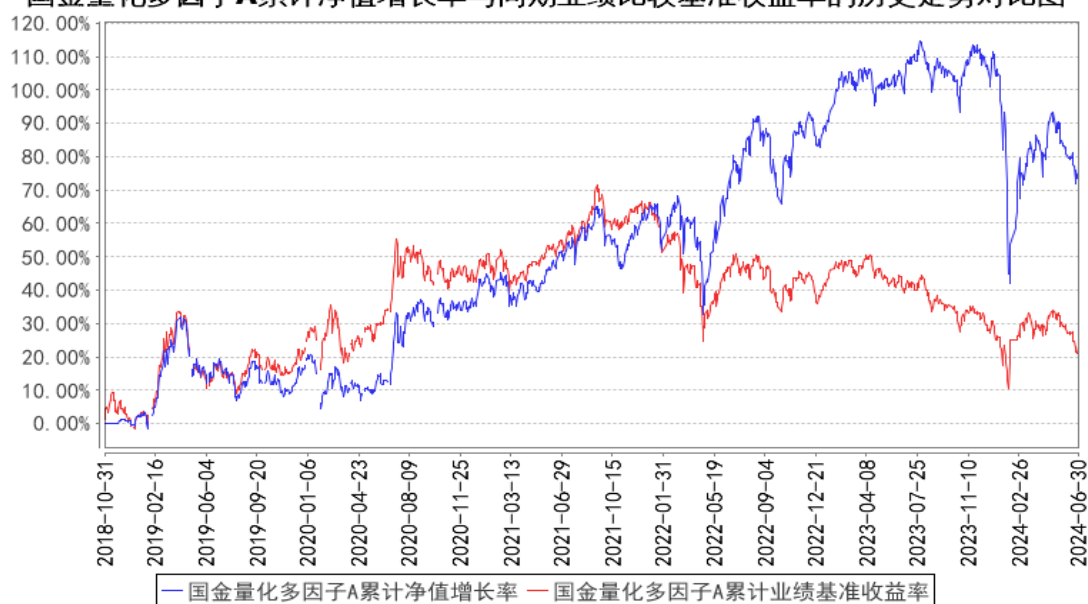
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.56%	0.98%	-5.74%	0.81%	1.18%	0.17%

过去三个月	-4.17%	1.25%	-5.23%	0.97%	1.06%	0.28%
过去六个月	-16.77%	2.09%	-6.90%	1.36%	-9.87%	0.73%
过去一年	-16.18%	1.56%	-14.14%	1.08%	-2.04%	0.48%
自基金合同生效起至今	-0.09%	1.32%	-11.62%	0.95%	11.53%	0.37%

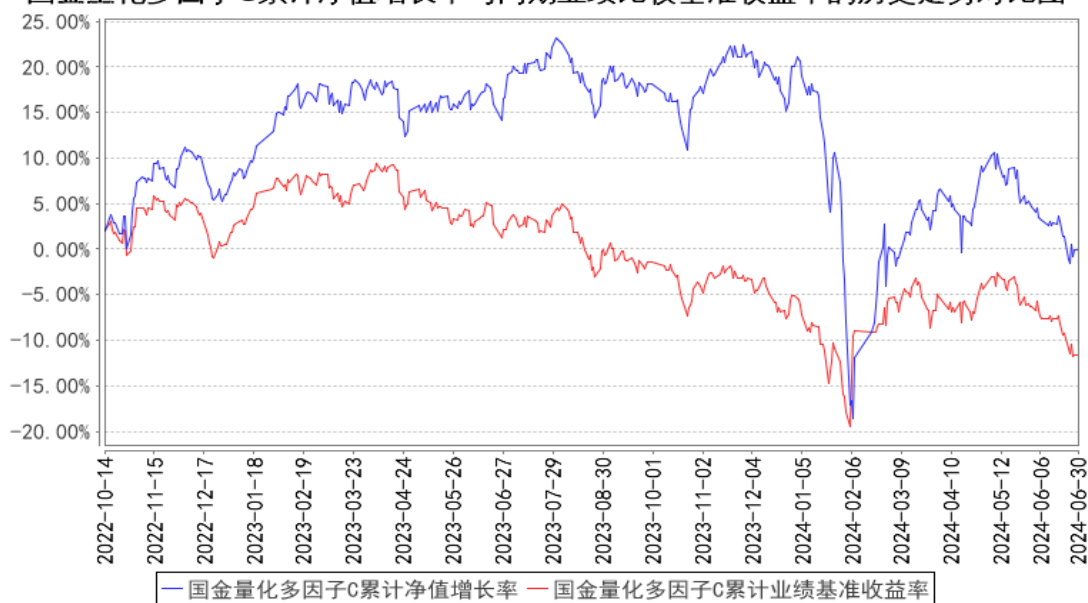
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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

国金量化多因子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



国金量化多因子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 类合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，图示日期为 2018 年 10 月 31 日至 2024 年 6 月



30 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2022 年 10 月 14 日，图示日期为 2022 年 10 月 14 日至 2024 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 2024 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 26 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金。

#### 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	-	8 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有

					限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资中心副总经理。
姚加红	本基金的基金经理	2023 年 1 月 5 日	-	20 年	姚加红先生，北京航空航天大学硕士。2004 年 4 月至 2011 年 5 月在博时基金管理有限公司任信息技术部高级程序员。2011 年 6 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部总经理、指数投资事业部副总经理，现任量化投资中心总经理。

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

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
姚加红	公募基金	2	5,234,622,000.60	2023 年 01 月 05 日
	私募资产管理计划	5	771,838,063.18	2016 年 04 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	6,006,460,063.78	-

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严

格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易次数为 6 次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 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，市场环境方面：2024 年 2 月前后的市场波动为近十年高点，后续虽有所降低，4 月和 5 月的波动水平仍处于历史较高位置，市场活跃度呈现持续下降的趋势，处于 2019 年以来的较低水平位置。具体因子方面：报告期内动量因子收益持续性较强，市值类和残差波动等因子波动性较大、持续性较弱。行业涨跌方面：大部分行业在报告期内录得负收益，其中涨幅高于 10% 的行业为银行、煤炭、石油石化和家电等，综合、消费者服务和计算机等行业跌幅较大，最大跌幅超过 37%。

本基金自 2024 年 2 月回撤以来，回升过程中的收益和风险特征符合对应市场环境下的预期，与长期市场表现一致性较强。国金量化策略收益来源多样化、持仓分散度高。量化策略是不断储备和迭代优化的过程，风险模型的优化一定程度上或降低相对收益的波动。

#### 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 1.7474 元，累计单位净值为 1.7474 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-16.60%，同期业绩比较基准增长率为-6.90%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.7360 元，累计单位净值为 1.7360 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-16.77%，同期业绩比较基准增长率为-6.90%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场环境下，伴随市场活跃度较低的特征，市场风格的切换或较为频繁。但基于历史数据，较大范围偏离均值的情况其均值回归的动力亦较强。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国金量化多因子股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	107,549,614.81	533,589,354.26
结算备付金		49,682,564.71	46,815,213.75
存出保证金		2,435,366.99	4,881,490.85
交易性金融资产	6.4.7.2	3,662,001,593.26	9,647,785,304.10
其中：股票投资		3,502,489,785.99	9,366,157,331.49
基金投资		-	-
债券投资		159,511,807.27	281,627,972.61
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		18,933,698.67	84,048,991.73
应收股利		-	-
应收申购款		2,664,994.11	12,136,926.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	1,973.17	-
资产总计		3,843,269,805.72	10,329,257,281.53

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<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		-	-
应付赎回款		13,612,253.40	110,173,605.05
应付管理人报酬		4,123,265.25	10,882,329.02
应付托管费		687,210.86	1,813,721.47
应付销售服务费		479,328.53	1,521,528.60
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	22,549,486.60	9,147,402.14
负债合计		41,451,544.64	133,538,586.28
<b>净 资 产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,180,193,969.34	4,874,956,466.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,621,624,291.74	5,320,762,228.73
净资产合计		3,801,818,261.08	10,195,718,695.25
负债和净资产总计		3,843,269,805.72	10,329,257,281.53

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国金量化多因子 A 基金份额净值 1.7474 元，基金份额总额 1,487,991,013.73 份；国金量化多因子 C 基金份额净值 1.7360 元，基金份额总额 692,202,955.61 份。国金量化多因子份额总额合计为 2,180,193,969.34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,762,744,436.56	406,416,885.19
1. 利息收入		692,251.98	4,053,416.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	648,247.65	1,032,429.06
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		44,004.33	3,020,987.28
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,685,044,636.00	378,486,068.49
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,728,622,395.94	331,072,391.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,078,168.75	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	40,499,591.19	47,413,676.70
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	-83,709,522.27	14,929,677.04
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	5,317,469.73	8,947,723.32
<b>减：二、营业总支出</b>		43,103,055.77	42,253,766.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,427,162.66	34,482,353.95
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,571,193.78	4,597,647.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,959,043.97	3,037,461.29
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	145,655.36	136,303.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,805,847,492.33	364,163,119.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,805,847,492.33	364,163,119.08

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,805,847,492.33	364,163,119.08

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	4,874,956,466. 52	-	5,320,762,228. 73	10,195,718,695. 25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,874,956,466. 52	-	5,320,762,228. 73	10,195,718,695. 25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 2,694,762,497. 18	-	- 3,699,137,936. 99	- 6,393,900,434.1 7
(一)、综合收益总额	-	-	- 1,805,847,492. 33	- 1,805,847,492.3 3
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 2,694,762,497. 18	-	- 1,893,290,444. 66	- 4,588,052,941.8 4
其中：1. 基金申购款	955,357,545.33	-	767,650,289.38	1,723,007,834.7 1
2. 基金赎回款	- 3,650,120,042. 51	-	- 2,660,940,734. 04	- 6,311,060,776.5 5



(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,180,193,969.34	-	1,621,624,291.74	3,801,818,261.08
项目	上年度可比期间 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	1,192,692,240.49	-	1,005,258,899.66	2,197,951,140.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,192,692,240.49	-	1,005,258,899.66	2,197,951,140.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,810,099,571.28	-	2,221,197,347.93	4,031,296,919.21
(一)、综合收益总额	-	-	364,163,119.08	364,163,119.08
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,810,099,571.28	-	1,857,034,228.85	3,667,133,800.13
其中：1. 基金申购款	3,504,505,738.35	-	3,581,397,763.92	7,085,903,502.27
2. 基金赎回款	-1,694,406,167.07	-	-1,724,363,535.07	-3,418,769,702.14

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,002,791,811.77	-	3,226,456,247.59	6,229,248,059.36

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：

邰海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国金量化多因子股票型证券投资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[2018]1050 号文《关于准予国金量化多因子股票型证券投资基金注册的批复》注册，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2018 年 10 月 31 日生效，本基金首次募集规模为 249,293,966.03 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《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于 2022 年 10 月 14 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核准发行上市的股票）、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 80%-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，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券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： $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

#### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	107,549,614.81
等于：本金	107,536,327.22
加：应计利息	13,287.59
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	107,549,614.81

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,719,649,682.15	-	3,502,489,785.99	- 217,159,896.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	156,999,522.32	2,454,557.27	159,511,807.27 57,727.68
	银行间市场	-	-	-
	合计	156,999,522.32	2,454,557.27	159,511,807.27 57,727.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,876,649,204.47	2,454,557.27	3,662,001,593.26	- 217,102,168.48

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	1,973.17
待摊费用	-
合计	1,973.17

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,709.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,425,431.98
其中：交易所市场	22,425,431.98
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,344.68
合计	22,549,486.60

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 国金量化多因子 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,907,275,946.13	2,907,275,946.13
本期申购	496,486,649.79	496,486,649.79
本期赎回（以“-”号填列）	-1,915,771,582.19	-1,915,771,582.19
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	1,487,991,013.73	1,487,991,013.73

## 国金量化多因子 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,967,680,520.39	1,967,680,520.39
本期申购	458,870,895.54	458,870,895.54
本期赎回（以“-”号填列）	-1,734,348,460.32	-1,734,348,460.32
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	692,202,955.61	692,202,955.61

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

## 国金量化多因子 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,241,807,305.29	-57,498,522.22	3,184,308,783.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,241,807,305.29	-57,498,522.22	3,184,308,783.07
本期利润	-1,118,784,551.82	27,600,729.88	-1,091,183,821.94
本期基金份额交易产生的变动数	-1,275,191,813.33	294,220,476.04	-980,971,337.29
其中：基金申购款	430,471,041.87	-28,845,747.53	401,625,294.34
基金赎回款	-1,705,662,855.20	323,066,223.57	-1,382,596,631.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	847,830,940.14	264,322,683.70	1,112,153,623.84

## 国金量化多因子 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,091,923,534.48	44,529,911.18	2,136,453,445.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,091,923,534.48	44,529,911.18	2,136,453,445.66
本期利润	-603,353,418.24	-111,310,252.15	-714,663,670.39
本期基金份额交易产生的变动数	-1,130,584,266.63	218,265,159.26	-912,319,107.37
其中：基金申购款	354,098,903.82	11,926,091.22	366,024,995.04
基金赎回款	-1,484,683,170.45	206,339,068.04	-1,278,344,102.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	357,985,849.61	151,484,818.29	509,470,667.90

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	403,336.59
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	219,940.78
其他	24,970.28
合计	648,247.65

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,728,622,395.94
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	-1,728,622,395.94

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	26,838,988,804.75
减：卖出股票成本总额	28,528,900,510.28
减：交易费用	38,710,690.41
买卖股票差价收入	-1,728,622,395.94

## 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,054,160.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,024,008.32
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	3,078,168.75

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	219,410,765.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	216,435,899.68
减：应计利息总额	1,950,857.97
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,024,008.32

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	40,499,591.19
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	40,499,591.19

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-83,709,522.27
股票投资	-83,027,891.95
债券投资	-681,630.32
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	-83,709,522.27

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	4,740,684.37
基金转换费收入	576,785.36
合计	5,317,469.73

## 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
	2024年1月1日至2024年6月30日

审计费用	59,672.34
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	26,310.68
合计	145,655.36

#### 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
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,224,793,574.80	2.47	-	-

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
国金证券 股份有限 公司	241,633,012.80	76.88	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

#### 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 2024年1月1日至2024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	546,127.21	2.47	546,127.21	2.44
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
-	-	-	-	-

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,427,162.66	34,482,353.95
其中：应支付销售机构的客户维	11,036,433.64	10,368,540.03

护费		
应支付基金管理人的净管理费	22,390,729.02	24,113,813.92

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

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,571,193.78	4,597,647.16

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

#### 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
国金基金管理有限公司	-	1,048,382.31	1,048,382.31
国金证券股份有限公司	-	210,543.87	210,543.87
合计	-	1,258,926.18	1,258,926.18
	上年度可比期间		

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
国金基金管理有限公司	-	932,854.26	932,854.26
国金证券股份有限公司	-	172,056.78	172,056.78
合计	-	1,104,911.04	1,104,911.04

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国银行股份有限公司-活期存款	107,549,614.81	403,336.59	387,040,411.65	654,982.75

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024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

注：无

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于2024年6月30日，本基金持有994,600.00股ST富通（股票代码：000836）成本总额为人民币1,643,154.00元。根据相关公告，该股票自2024年6月18日起停牌，于2024年8月1日被终止上市，于2024年8月12日摘牌。

基金管理人于2024年6月22日发布《国金基金管理有限公司关于旗下基金调整股票估值方法的提示性公告》，经与相关托管人协商一致，自2024年6月21日起对“ST富通”（股票代码：000836）按照人民币0.00元估值，详见基金管理人在规定媒介披露的相关公告。

##### 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。

总经理办公会负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理办公会下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

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

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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 2024年6 月30日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	107,549,614.81	-	-	-	-	-	107,549,614.81
结算备付金	49,682,564.71	-	-	-	-	-	49,682,564.71
存出保证金	2,435,366.99	-	-	-	-	-	2,435,366.99
交易性金融资产	15,234,226.03	-	144,277,581.24	-	-	3,502,489,785.99	3,662,001,593.26
应收清算款	-	-	-	-	-	18,933,698.67	18,933,698.67
应收申购款	-	-	-	-	-	2,664,994.11	2,664,994.11
其他资产	-	-	-	-	-	1,973.17	1,973.17
资产总计	174,901,772.54	-	144,277,581.24	-	-	3,524,090,451.94	3,843,269,805.72
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,612,253.40	13,612,253.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,123,265.25	4,123,265.25

应付托管费						687,210.86	687,210.86
应付销售服务费						479,328.53	479,328.53
其他负债						22,549,486.60	22,549,486.60
负债总计						41,451,544.64	41,451,544.64
利率敏感度缺口	174,901,772.54		-144,277,581.24			-3,482,638,907.30	3,801,818,261.08
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	533,589,354.26						533,589,354.26
结算备付金	46,815,213.75						46,815,213.75
存出保证金	4,881,490.85						4,881,490.85
交易性金融资产			-281,627,972.61			-9,366,157,331.49	9,647,785,304.10
应收清算款						84,048,991.73	84,048,991.73
应收申购款						12,136,926.84	12,136,926.84
资产总计	585,286,058.86		-281,627,972.61			-9,462,343,250.06	10,329,257,281.53
负债							
应付赎回款						110,173,605.05	110,173,605.05
应付管理人报酬						10,882,329.02	10,882,329.02
应付托管费						1,813,721.47	1,813,721.47
应付销售服务费						1,521,528.60	1,521,528.60
其他负债						9,147,402.14	9,147,402.14
负债总计						133,538,586.28	133,538,586.28
利率敏感度缺口	585,286,058.86		-281,627,972.61			-9,328,804,663.78	10,195,718,695.25

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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,502,489,785.99	92.13	9,366,157,331.49	91.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	159,511,807.27	4.20	281,627,972.61	2.76
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,662,001,593.26	96.32	9,647,785,304.10	94.63

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。
	对资产负债表日基金资产净值的

分析	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	+5%	144,704,338.64	433,359,625.94
-5%	-144,704,338.64	-433,359,625.94	

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,502,489,785.99	9,355,119,954.06
第二层次	159,511,807.27	292,659,267.90
第三层次	-	6,082.14
合计	3,662,001,593.26	9,647,785,304.10

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,502,489,785.99	91.13
	其中：股票	3,502,489,785.99	91.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	159,511,807.27	4.15
	其中：债券	159,511,807.27	4.15
	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	157,232,179.52	4.09
8	其他各项资产	24,036,032.94	0.63
9	合计	3,843,269,805.72	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	2,456,895.00	0.06
B	采矿业	76,966,703.20	2.02
C	制造业	2,519,408,838.28	66.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,916,015.29	1.79
E	建筑业	83,582,809.84	2.20



F	批发和零售业	48,095,906.56	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	37,493,183.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	418,892,275.76	11.02
J	金融业	127,449,127.79	3.35
K	房地产业	3,843,257.00	0.10
L	租赁和商务服务业	17,877,761.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	25,357,465.33	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	24,210,932.94	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,611,697.00	0.44
Q	卫生和社会工作	947,175.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	24,523,848.00	0.65
S	综合	6,855,895.00	0.18
	合计	3,502,489,785.99	92.13

### 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	000651	格力电器	1,367,100	53,617,662.00	1.41
2	603501	韦尔股份	515,840	51,259,020.80	1.35
3	601728	中国电信	7,529,300	46,305,195.00	1.22
4	600690	海尔智家	1,416,334	40,195,558.92	1.06
5	600900	长江电力	1,375,300	39,773,676.00	1.05
6	601668	中国建筑	6,315,389	33,534,715.59	0.88
7	600362	江西铜业	1,313,101	31,094,231.68	0.82
8	601766	中国中车	4,032,900	30,287,079.00	0.80
9	601127	赛力斯	322,300	29,367,976.00	0.77
10	002241	歌尔股份	1,499,500	29,255,245.00	0.77
11	002371	北方华创	91,400	29,237,946.00	0.77
12	600050	中国联通	6,016,300	28,276,610.00	0.74
13	000333	美的集团	418,100	26,967,450.00	0.71
14	600941	中国移动	244,600	26,294,500.00	0.69
15	601877	正泰电器	1,354,400	25,814,864.00	0.68
16	600183	生益科技	1,204,500	25,366,770.00	0.67
17	002841	视源股份	850,800	25,124,124.00	0.66
18	600887	伊利股份	969,700	25,057,048.00	0.66
19	300408	三环集团	833,525	24,330,594.75	0.64

20	605499	东鹏饮料	106,900	23,063,675.00	0.61
21	000063	中兴通讯	794,574	22,224,234.78	0.58
22	002236	大华股份	1,435,800	22,197,468.00	0.58
23	601865	福莱特	1,101,100	22,132,110.00	0.58
24	300207	欣旺达	1,401,400	21,259,238.00	0.56
25	600346	恒力石化	1,521,290	21,221,995.50	0.56
26	601686	友发集团	3,786,700	19,047,101.00	0.50
27	600019	宝钢股份	2,816,400	18,729,060.00	0.49
28	002625	光启技术	1,055,400	18,311,190.00	0.48
29	688819	天能股份	742,721	17,721,323.06	0.47
30	600707	彩虹股份	2,471,000	16,827,510.00	0.44
31	600989	宝丰能源	945,300	16,382,049.00	0.43
32	601336	新华保险	540,100	16,219,203.00	0.43
33	601633	长城汽车	633,400	16,025,020.00	0.42
34	002607	中公教育	10,336,600	15,814,998.00	0.42
35	000066	中国长城	1,807,400	15,814,750.00	0.42
36	601800	中国交建	1,689,200	15,101,448.00	0.40
37	600282	南钢股份	3,011,300	14,996,274.00	0.39
38	600219	南山铝业	3,865,900	14,729,079.00	0.39
39	601688	华泰证券	1,174,300	14,549,577.00	0.38
40	600018	上港集团	2,498,500	14,441,330.00	0.38
41	600015	华夏银行	2,248,100	14,387,840.00	0.38
42	601818	光大银行	4,495,600	14,251,052.00	0.37
43	601231	环旭电子	878,600	14,101,530.00	0.37
44	000513	丽珠集团	370,400	13,782,584.00	0.36
45	603260	合盛硅业	288,100	13,457,151.00	0.35
46	600309	万华化学	164,900	13,333,814.00	0.35
47	600582	天地科技	1,835,400	12,645,906.00	0.33
48	300223	北京君正	225,600	12,507,264.00	0.33
49	002185	华天科技	1,527,018	12,445,196.70	0.33
50	002436	兴森科技	1,188,200	12,262,224.00	0.32
51	603893	瑞芯微	206,000	12,189,020.00	0.32
52	688036	传音控股	158,243	12,111,919.22	0.32
53	688167	炬光科技	218,674	12,027,070.00	0.32
54	601169	北京银行	2,052,700	11,987,768.00	0.32
55	600036	招商银行	350,180	11,972,654.20	0.31
56	601567	三星医疗	335,000	11,725,000.00	0.31
57	601898	中煤能源	919,900	11,480,352.00	0.30
58	600674	川投能源	607,700	11,394,375.00	0.30
59	000636	风华高科	847,900	11,073,574.00	0.29
60	600985	淮北矿业	655,500	10,973,070.00	0.29
61	600566	济川药业	345,900	10,968,489.00	0.29
62	601601	中国太保	385,611	10,743,122.46	0.28

63	600096	云天化	552,900	10,737,318.00	0.28
64	600498	烽火通信	650,800	10,347,720.00	0.27
65	603160	汇顶科技	150,000	10,312,500.00	0.27
66	000708	中信特钢	739,800	10,039,086.00	0.26
67	300724	捷佳伟创	185,400	10,013,454.00	0.26
68	601216	君正集团	2,691,800	9,932,742.00	0.26
69	688798	艾为电子	168,472	9,538,884.64	0.25
70	002532	天山铝业	1,174,682	9,526,671.02	0.25
71	603118	共进股份	1,408,100	9,434,270.00	0.25
72	600999	招商证券	677,900	9,429,589.00	0.25
73	601969	海南矿业	1,478,930	9,376,416.20	0.25
74	600398	海澜之家	1,013,100	9,361,044.00	0.25
75	600588	用友网络	931,000	9,310,000.00	0.24
76	601229	上海银行	1,278,066	9,278,759.16	0.24
77	600968	海油发展	2,183,300	8,995,196.00	0.24
78	688187	时代电气	179,457	8,861,586.66	0.23
79	601609	金田股份	1,532,100	8,671,686.00	0.23
80	600104	上汽集团	624,700	8,658,342.00	0.23
81	688041	海光信息	122,592	8,620,669.44	0.23
82	300379	东方通	1,054,600	8,521,168.00	0.22
83	002056	横店东磁	677,400	8,447,178.00	0.22
84	603328	依顿电子	1,070,400	8,413,344.00	0.22
85	600610	中毅达	2,106,700	8,384,666.00	0.22
86	600562	国睿科技	604,500	8,257,470.00	0.22
87	600745	闻泰科技	285,500	8,065,375.00	0.21
88	000810	创维数字	939,722	8,062,814.76	0.21
89	688153	唯捷创芯	214,378	7,931,986.00	0.21
90	002745	木林森	976,700	7,872,202.00	0.21
91	601366	利群股份	1,710,900	7,699,050.00	0.20
92	002415	海康威视	247,000	7,634,770.00	0.20
93	601717	郑煤机	509,458	7,539,978.40	0.20
94	600552	凯盛科技	793,800	7,485,534.00	0.20
95	002174	游族网络	980,400	7,441,236.00	0.20
96	603185	弘元绿能	435,011	7,434,337.99	0.20
97	600316	洪都航空	441,400	7,340,482.00	0.19
98	300782	卓胜微	93,180	7,243,813.20	0.19
99	300088	长信科技	1,537,566	7,226,560.20	0.19
100	301316	慧博云通	488,900	7,177,052.00	0.19
101	002414	高德红外	1,191,274	7,016,603.86	0.18
102	002212	天融信	1,437,200	6,999,164.00	0.18
103	688733	壹石通	467,144	6,983,802.80	0.18
104	603296	华勤技术	126,100	6,964,503.00	0.18
105	600377	宁沪高速	552,700	6,964,020.00	0.18

106	600261	阳光照明	2,576,300	6,956,010.00	0.18
107	600100	同方股份	1,363,300	6,939,197.00	0.18
108	603212	赛伍技术	613,600	6,774,144.00	0.18
109	603583	捷昌驱动	327,700	6,678,526.00	0.18
110	300079	数码视讯	1,637,600	6,648,656.00	0.17
111	300188	国投智能	591,700	6,573,787.00	0.17
112	600970	中材国际	544,600	6,567,876.00	0.17
113	688388	嘉元科技	673,392	6,565,572.00	0.17
114	600673	东阳光	927,000	6,526,080.00	0.17
115	002402	和而泰	602,500	6,452,775.00	0.17
116	600877	电科芯片	599,600	6,427,712.00	0.17
117	002683	广东宏大	311,700	6,274,521.00	0.17
118	688158	优刻得	612,812	6,269,066.76	0.16
119	688680	海优新材	211,928	6,090,810.72	0.16
120	600606	绿地控股	4,483,015	6,052,070.25	0.16
121	600295	鄂尔多斯	606,560	6,017,075.20	0.16
122	300136	信维通信	307,100	6,013,018.00	0.16
123	601311	骆驼股份	747,300	5,993,346.00	0.16
124	605589	圣泉集团	294,000	5,965,260.00	0.16
125	000100	TCL 科技	1,376,600	5,946,912.00	0.16
126	603113	金能科技	1,068,600	5,845,242.00	0.15
127	600667	太极实业	1,020,300	5,825,913.00	0.15
128	300377	赢时胜	1,143,200	5,807,456.00	0.15
129	300628	亿联网络	157,660	5,797,158.20	0.15
130	000338	潍柴动力	356,000	5,781,440.00	0.15
131	605166	聚合顺	549,600	5,765,304.00	0.15
132	600623	华谊集团	990,302	5,723,945.56	0.15
133	300323	华灿光电	1,315,300	5,721,555.00	0.15
134	600741	华域汽车	347,100	5,685,498.00	0.15
135	300433	蓝思科技	308,100	5,622,825.00	0.15
136	600177	雅戈尔	789,300	5,619,816.00	0.15
137	300182	捷成股份	1,504,800	5,582,808.00	0.15
138	688127	蓝特光学	303,296	5,577,613.44	0.15
139	600330	天通股份	814,500	5,538,600.00	0.15
140	002139	拓邦股份	520,300	5,525,586.00	0.15
141	603666	亿嘉和	349,600	5,516,688.00	0.15
142	688133	泰坦科技	349,229	5,510,833.62	0.14
143	300085	银之杰	682,000	5,510,560.00	0.14
144	002777	久远银海	364,800	5,468,352.00	0.14
145	600098	广州发展	849,500	5,436,800.00	0.14
146	600776	东方通信	552,800	5,434,024.00	0.14
147	600997	开滦股份	790,900	5,425,574.00	0.14
148	002318	久立特材	232,400	5,421,892.00	0.14

149	001218	丽臣实业	360,140	5,391,295.80	0.14
150	688152	麒麟信安	138,639	5,368,102.08	0.14
151	600366	宁波韵升	1,024,400	5,347,368.00	0.14
152	600732	爱旭股份	587,800	5,319,590.00	0.14
153	688586	江航装备	568,597	5,287,952.10	0.14
154	600150	中国船舶	129,400	5,267,874.00	0.14
155	688400	凌云光	313,146	5,223,275.28	0.14
156	300866	安克创新	73,300	5,219,693.00	0.14
157	000902	新洋丰	434,000	5,151,580.00	0.14
158	603026	石大胜华	151,500	5,120,700.00	0.13
159	300296	利亚德	1,133,300	5,099,850.00	0.13
160	600801	华新水泥	370,500	5,094,375.00	0.13
161	600508	上海能源	359,500	5,086,925.00	0.13
162	600886	国投电力	274,654	5,009,688.96	0.13
163	688800	瑞可达	176,775	4,963,842.00	0.13
164	300077	国民技术	567,800	4,956,894.00	0.13
165	300369	绿盟科技	965,100	4,931,661.00	0.13
166	688711	宏微科技	306,674	4,925,184.44	0.13
167	600299	安迪苏	505,300	4,901,410.00	0.13
168	300113	顺网科技	478,500	4,899,840.00	0.13
169	688095	福昕软件	106,507	4,879,085.67	0.13
170	600850	电科数字	268,100	4,852,610.00	0.13
171	601989	中国重工	983,600	4,849,148.00	0.13
172	603989	艾华集团	342,100	4,809,926.00	0.13
173	300271	华宇软件	1,014,300	4,746,924.00	0.12
174	301205	联特科技	75,600	4,743,900.00	0.12
175	600660	福耀玻璃	98,900	4,737,310.00	0.12
176	002416	爱施德	534,000	4,725,900.00	0.12
177	000723	美锦能源	989,000	4,707,640.00	0.12
178	688031	星环科技	127,922	4,696,016.62	0.12
179	688057	金达莱	477,144	4,680,782.64	0.12
180	300212	易华录	278,000	4,678,740.00	0.12
181	300303	聚飞光电	960,800	4,669,488.00	0.12
182	002036	联创电子	690,700	4,662,225.00	0.12
183	600399	抚顺特钢	824,000	4,639,120.00	0.12
184	300747	锐科激光	259,775	4,611,006.25	0.12
185	000681	视觉中国	400,100	4,601,150.00	0.12
186	300674	宇信科技	414,900	4,597,092.00	0.12
187	002171	楚江新材	697,400	4,595,866.00	0.12
188	600392	盛和资源	533,030	4,594,718.60	0.12
189	603833	欧派家居	85,600	4,584,736.00	0.12
190	300679	电连技术	113,700	4,574,151.00	0.12
191	600372	中航机载	381,600	4,567,752.00	0.12

192	600075	新疆天业	1,317,593	4,545,695.85	0.12
193	603700	宁水集团	479,500	4,497,710.00	0.12
194	601222	林洋能源	717,100	4,496,217.00	0.12
195	600126	杭钢股份	1,087,900	4,471,269.00	0.12
196	688311	盟升电子	213,853	4,381,847.97	0.12
197	600511	国药股份	141,704	4,363,066.16	0.11
198	300190	维尔利	1,569,800	4,316,950.00	0.11
199	600143	金发科技	650,600	4,300,466.00	0.11
200	600363	联创光电	155,700	4,284,864.00	0.11
201	002595	豪迈科技	110,665	4,224,083.05	0.11
202	688339	亿华通	140,807	4,221,393.86	0.11
203	603466	风语筑	494,000	4,218,760.00	0.11
204	603995	甬金股份	239,900	4,203,048.00	0.11
205	688106	金宏气体	239,204	4,190,854.08	0.11
206	000825	太钢不锈	1,235,200	4,174,976.00	0.11
207	603297	永新光学	68,800	4,161,712.00	0.11
208	002064	华峰化学	572,500	4,104,825.00	0.11
209	688707	振华新材	419,905	4,089,874.70	0.11
210	601101	昊华能源	441,300	4,055,547.00	0.11
211	605376	博迁新材	175,900	3,970,063.00	0.10
212	603348	文灿股份	142,300	3,940,287.00	0.10
213	600971	恒源煤电	328,600	3,923,484.00	0.10
214	002786	银宝山新	489,000	3,921,780.00	0.10
215	688001	华兴源创	173,337	3,913,949.46	0.10
216	300428	立中集团	210,400	3,911,336.00	0.10
217	600797	浙大网新	832,500	3,854,475.00	0.10
218	002913	奥士康	143,300	3,841,873.00	0.10
219	688234	天岳先进	80,640	3,783,628.80	0.10
220	688098	申联生物	904,317	3,771,001.89	0.10
221	002283	天润工业	877,000	3,762,330.00	0.10
222	300766	每日互动	379,100	3,749,299.00	0.10
223	002545	东方铁塔	547,700	3,729,837.00	0.10
224	688297	中无人机	112,499	3,715,841.97	0.10
225	002453	华软科技	857,200	3,677,388.00	0.10
226	300319	麦捷科技	394,000	3,676,020.00	0.10
227	600409	三友化工	729,300	3,661,086.00	0.10
228	600618	氯碱化工	416,200	3,654,236.00	0.10
229	603317	天味食品	319,600	3,646,636.00	0.10
230	002010	传化智联	943,400	3,622,656.00	0.10
231	603098	森特股份	458,000	3,599,880.00	0.09
232	002008	大族激光	173,000	3,598,400.00	0.09
233	300432	富临精工	554,300	3,569,692.00	0.09
234	688608	恒玄科技	24,251	3,549,861.38	0.09

235	000062	深圳华强	395,316	3,518,312.40	0.09
236	601187	厦门银行	653,200	3,481,556.00	0.09
237	603806	福斯特	236,740	3,480,078.00	0.09
238	603660	苏州科达	636,800	3,476,928.00	0.09
239	603629	利通电子	188,300	3,476,018.00	0.09
240	300331	苏大维格	213,600	3,434,688.00	0.09
241	600391	航发科技	225,200	3,434,300.00	0.09
242	601869	长飞光纤	140,700	3,423,231.00	0.09
243	002978	安宁股份	122,700	3,418,422.00	0.09
244	002549	凯美特气	668,500	3,416,035.00	0.09
245	002488	金固股份	775,150	3,402,908.50	0.09
246	603881	数据港	267,046	3,394,154.66	0.09
247	600873	梅花生物	338,500	3,391,770.00	0.09
248	603906	龙蟠科技	434,100	3,381,639.00	0.09
249	300183	东软载波	292,000	3,381,360.00	0.09
250	002123	梦网科技	480,200	3,375,806.00	0.09
251	001203	大中矿业	349,300	3,356,773.00	0.09
252	600925	苏能股份	662,900	3,347,645.00	0.09
253	688172	燕东微	206,601	3,342,804.18	0.09
254	300366	创意信息	459,900	3,329,676.00	0.09
255	000503	国新健康	498,000	3,321,660.00	0.09
256	300687	赛意信息	238,200	3,315,744.00	0.09
257	688372	伟测科技	84,181	3,310,838.73	0.09
258	688169	石头科技	8,412	3,302,551.20	0.09
259	688173	希荻微	297,781	3,284,524.43	0.09
260	603887	城地香江	627,500	3,269,275.00	0.09
261	688238	和元生物	703,356	3,256,538.28	0.09
262	603938	三孚股份	275,500	3,237,125.00	0.09
263	600151	航天机电	715,000	3,231,800.00	0.09
264	300846	首都在线	344,700	3,226,392.00	0.08
265	603527	众源新材	454,400	3,226,240.00	0.08
266	300559	佳发教育	337,100	3,226,047.00	0.08
267	603037	凯众股份	247,380	3,213,466.20	0.08
268	601212	白银有色	1,153,800	3,207,564.00	0.08
269	600410	华胜天成	827,900	3,203,973.00	0.08
270	605066	天正电气	571,500	3,183,255.00	0.08
271	601600	中国铝业	416,900	3,180,947.00	0.08
272	600703	三安光电	271,300	3,179,636.00	0.08
273	688567	孚能科技	330,931	3,176,937.60	0.08
274	002004	华邦健康	832,000	3,161,600.00	0.08
275	300232	洲明科技	604,700	3,156,534.00	0.08
276	600835	上海机电	273,800	3,151,438.00	0.08
277	603915	国茂股份	305,900	3,147,711.00	0.08

278	603898	好莱客	428,100	3,146,535.00	0.08
279	300382	斯莱克	526,600	3,112,206.00	0.08
280	688292	浩瀚深度	200,776	3,103,996.96	0.08
281	002649	博彦科技	387,800	3,086,888.00	0.08
282	601677	明泰铝业	264,500	3,057,620.00	0.08
283	601369	陕鼓动力	380,300	3,050,006.00	0.08
284	002249	大洋电机	644,380	3,047,917.40	0.08
285	002001	新和成	158,100	3,035,520.00	0.08
286	002354	天娱数科	1,014,500	3,033,355.00	0.08
287	301318	维海德	110,350	3,031,314.50	0.08
288	603017	中衡设计	341,400	3,024,804.00	0.08
289	688023	安恒信息	75,437	3,018,234.37	0.08
290	600563	法拉电子	39,500	3,009,110.00	0.08
291	601015	陕西黑猫	1,073,400	3,005,520.00	0.08
292	603728	鸣志电器	74,300	2,989,089.00	0.08
293	300322	硕贝德	354,400	2,969,872.00	0.08
294	688590	新致软件	229,756	2,963,852.40	0.08
295	600460	士兰微	169,000	2,959,190.00	0.08
296	600810	神马股份	477,243	2,958,906.60	0.08
297	601598	中国外运	522,700	2,942,801.00	0.08
298	300741	华宝股份	191,800	2,923,032.00	0.08
299	600577	精达股份	735,100	2,918,347.00	0.08
300	605222	起帆电缆	188,800	2,896,192.00	0.08
301	600893	航发动力	79,200	2,894,760.00	0.08
302	300456	赛微电子	180,800	2,869,296.00	0.08
303	603333	尚纬股份	916,700	2,850,937.00	0.07
304	600000	浦发银行	344,639	2,836,378.97	0.07
305	300226	上海钢联	167,200	2,832,368.00	0.07
306	605333	沪光股份	101,600	2,829,560.00	0.07
307	002553	南方精工	305,000	2,827,350.00	0.07
308	300608	思特奇	313,600	2,816,128.00	0.07
309	600206	有研新材	316,000	2,812,400.00	0.07
310	603636	南威软件	363,000	2,795,100.00	0.07
311	600510	黑牡丹	750,700	2,792,604.00	0.07
312	002101	广东鸿图	264,121	2,781,194.13	0.07
313	600640	国脉文化	266,500	2,758,275.00	0.07
314	600699	均胜电子	185,500	2,749,110.00	0.07
315	603918	金桥信息	263,000	2,748,350.00	0.07
316	600841	动力新科	833,400	2,733,552.00	0.07
317	600449	宁夏建材	231,300	2,717,775.00	0.07
318	600490	鹏欣资源	1,044,500	2,715,700.00	0.07
319	300134	大富科技	397,775	2,712,825.50	0.07
320	601949	中国出版	458,300	2,708,553.00	0.07



321	601098	中南传媒	217,800	2,705,076.00	0.07
322	300045	华力创通	153,100	2,702,215.00	0.07
323	600152	维科技术	562,600	2,700,480.00	0.07
324	002735	王子新材	274,300	2,696,369.00	0.07
325	601568	北元集团	724,520	2,687,969.20	0.07
326	002705	新宝股份	191,000	2,687,370.00	0.07
327	002498	汉缆股份	814,000	2,678,060.00	0.07
328	601001	晋控煤业	160,900	2,658,068.00	0.07
329	601038	一拖股份	167,100	2,641,851.00	0.07
330	688088	虹软科技	91,110	2,629,434.60	0.07
331	688007	光峰科技	163,250	2,628,325.00	0.07
332	688159	有方科技	69,245	2,621,615.70	0.07
333	603071	物产环能	208,900	2,617,517.00	0.07
334	601003	柳钢股份	1,031,176	2,608,875.28	0.07
335	002527	新时达	434,400	2,602,056.00	0.07
336	600728	佳都科技	689,400	2,557,674.00	0.07
337	600039	四川路桥	323,800	2,554,782.00	0.07
338	003015	日久光电	280,500	2,546,940.00	0.07
339	000020	深华发 A	256,900	2,543,310.00	0.07
340	300553	集智股份	103,700	2,539,613.00	0.07
341	688365	光云科技	420,194	2,529,567.88	0.07
342	301185	鸥玛软件	175,800	2,519,214.00	0.07
343	601528	瑞丰银行	533,400	2,517,648.00	0.07
344	300620	光库科技	68,300	2,512,074.00	0.07
345	601218	吉鑫科技	893,800	2,493,702.00	0.07
346	600130	波导股份	775,500	2,473,845.00	0.07
347	601886	江河集团	505,300	2,465,864.00	0.06
348	688337	普源精电	97,501	2,458,975.22	0.06
349	300659	中孚信息	188,800	2,448,736.00	0.06
350	000923	河钢资源	140,500	2,419,410.00	0.06
351	300771	智莱科技	275,200	2,419,008.00	0.06
352	300349	金卡智能	202,100	2,409,032.00	0.06
353	000030	富奥股份	489,900	2,405,409.00	0.06
354	601208	东材科技	330,700	2,400,882.00	0.06
355	600328	中盐化工	349,640	2,398,530.40	0.06
356	603626	科森科技	429,600	2,388,576.00	0.06
357	002446	盛路通信	422,100	2,384,865.00	0.06
358	600782	新钢股份	714,500	2,372,140.00	0.06
359	002449	国星光电	331,100	2,357,432.00	0.06
360	603013	亚普股份	174,200	2,346,474.00	0.06
361	300825	阿尔特	241,800	2,343,042.00	0.06
362	688071	华依科技	107,978	2,339,883.26	0.06
363	603489	八方股份	86,100	2,322,978.00	0.06

364	603110	东方材料	207,900	2,313,927.00	0.06
365	002845	同兴达	174,300	2,304,246.00	0.06
366	600960	渤海汽车	863,600	2,297,176.00	0.06
367	603051	鹿山新材	105,200	2,296,516.00	0.06
368	300979	华利集团	37,700	2,294,045.00	0.06
369	300166	东方国信	372,500	2,279,700.00	0.06
370	300348	长亮科技	333,700	2,275,834.00	0.06
371	603156	养元饮品	106,700	2,269,509.00	0.06
372	300660	江苏雷利	88,900	2,268,728.00	0.06
373	600751	海航科技	1,016,500	2,256,630.00	0.06
374	600770	综艺股份	984,777	2,255,139.33	0.06
375	603187	海容冷链	193,280	2,253,644.80	0.06
376	600602	云赛智联	202,900	2,240,016.00	0.06
377	300170	汉得信息	364,500	2,238,030.00	0.06
378	688009	中国通号	372,537	2,235,222.00	0.06
379	300328	宜安科技	521,700	2,232,876.00	0.06
380	605338	巴比食品	167,600	2,220,700.00	0.06
381	688309	恒誉环保	184,636	2,213,785.64	0.06
382	688588	凌志软件	322,649	2,210,145.65	0.06
383	002439	启明星辰	126,740	2,187,532.40	0.06
384	688262	国芯科技	120,107	2,187,148.47	0.06
385	300227	光韵达	398,200	2,178,154.00	0.06
386	301159	三维天地	81,600	2,176,272.00	0.06
387	603595	东尼电子	105,400	2,170,186.00	0.06
388	300420	五洋自控	990,300	2,168,757.00	0.06
389	600237	铜峰电子	413,800	2,160,036.00	0.06
390	603266	天龙股份	127,600	2,158,992.00	0.06
391	603960	克来机电	102,200	2,156,420.00	0.06
392	300279	和晶科技	513,400	2,140,878.00	0.06
393	300805	电声股份	336,000	2,136,960.00	0.06
394	301007	德迈仕	182,600	2,132,768.00	0.06
395	002539	云图控股	298,700	2,129,731.00	0.06
396	002952	亚世光电	103,550	2,127,952.50	0.06
397	002376	新北洋	394,250	2,125,007.50	0.06
398	605208	永茂泰	340,951	2,124,124.73	0.06
399	605136	丽人丽妆	384,300	2,117,493.00	0.06
400	300768	迪普科技	177,400	2,102,190.00	0.06
401	002990	盛视科技	104,200	2,097,546.00	0.06
402	000016	深康佳 A	983,000	2,093,790.00	0.06
403	605365	立达信	131,600	2,088,492.00	0.05
404	601616	广电电气	716,200	2,084,142.00	0.05
405	300383	光环新网	246,600	2,083,770.00	0.05
406	300047	天源迪科	318,400	2,082,336.00	0.05

407	603396	金辰股份	64,100	2,081,327.00	0.05
408	000969	安泰科技	262,400	2,080,832.00	0.05
409	603115	海星股份	199,300	2,072,720.00	0.05
410	000157	中联重科	269,400	2,068,992.00	0.05
411	300606	金太阳	110,500	2,050,880.00	0.05
412	001319	铭科精技	125,700	2,048,910.00	0.05
413	301169	零点有数	71,100	2,047,680.00	0.05
414	600053	九鼎投资	147,500	2,045,825.00	0.05
415	603380	易德龙	100,332	2,014,666.56	0.05
416	688499	利元亨	105,168	2,011,863.84	0.05
417	603301	振德医疗	96,300	2,008,818.00	0.05
418	002516	旷达科技	549,700	2,000,908.00	0.05
419	002933	新兴装备	87,300	2,000,043.00	0.05
420	300168	万达信息	420,100	1,995,475.00	0.05
421	601298	青岛港	208,400	1,992,304.00	0.05
422	603189	网达软件	182,100	1,992,174.00	0.05
423	002657	中科金财	175,300	1,991,408.00	0.05
424	688383	新益昌	38,186	1,989,872.46	0.05
425	603768	常青股份	174,700	1,981,098.00	0.05
426	688209	英集芯	159,126	1,974,753.66	0.05
427	688579	山大地纬	251,304	1,972,736.40	0.05
428	300821	东岳硅材	288,200	1,971,288.00	0.05
429	002068	黑猫股份	277,400	1,969,540.00	0.05
430	300556	丝路视觉	116,800	1,954,064.00	0.05
431	300130	新国都	116,900	1,945,216.00	0.05
432	600135	乐凯胶片	398,500	1,944,680.00	0.05
433	002108	沧州明珠	635,500	1,944,630.00	0.05
434	002191	劲嘉股份	536,793	1,937,822.73	0.05
435	688367	工大高科	158,658	1,935,627.60	0.05
436	300032	金龙机电	621,400	1,932,554.00	0.05
437	603958	哈森股份	236,400	1,931,388.00	0.05
438	603618	杭电股份	440,800	1,930,704.00	0.05
439	603106	恒银科技	451,000	1,921,260.00	0.05
440	603609	禾丰股份	291,200	1,904,448.00	0.05
441	002009	天奇股份	166,600	1,889,244.00	0.05
442	601058	赛轮轮胎	134,700	1,885,800.00	0.05
443	688080	映翰通	62,060	1,882,279.80	0.05
444	600820	隧道股份	287,800	1,879,334.00	0.05
445	301326	捷邦科技	57,700	1,877,558.00	0.05
446	603926	铁流股份	226,100	1,876,630.00	0.05
447	300798	锦鸡股份	302,100	1,876,041.00	0.05
448	600775	南京熊猫	233,900	1,871,200.00	0.05
449	002369	卓翼科技	506,000	1,867,140.00	0.05

450	605118	力鼎光电	125,300	1,865,717.00	0.05
451	603949	雪龙集团	165,500	1,863,530.00	0.05
452	603556	海兴电力	39,700	1,859,151.00	0.05
453	300652	雷迪克	93,100	1,846,173.00	0.05
454	603232	格尔软件	176,900	1,843,298.00	0.05
455	688205	德科立	63,971	1,843,004.51	0.05
456	688070	纵横股份	64,900	1,834,074.00	0.05
457	688065	凯赛生物	40,157	1,822,726.23	0.05
458	001270	铖昌科技	49,400	1,813,968.00	0.05
459	603937	丽岛新材	233,300	1,810,408.00	0.05
460	301218	华是科技	87,400	1,810,054.00	0.05
461	603218	日月股份	175,700	1,804,439.00	0.05
462	688207	格灵深瞳	157,222	1,803,336.34	0.05
463	600642	申能股份	203,700	1,798,671.00	0.05
464	002998	优彩资源	315,900	1,791,153.00	0.05
465	002362	汉王科技	107,400	1,788,210.00	0.05
466	000727	冠捷科技	866,500	1,784,990.00	0.05
467	603138	海量数据	170,200	1,783,696.00	0.05
468	300921	南凌科技	102,700	1,778,764.00	0.05
469	603868	飞科电器	46,200	1,774,080.00	0.05
470	688028	沃尔德	107,337	1,763,546.91	0.05
471	603095	越剑智能	134,100	1,758,051.00	0.05
472	301067	显盈科技	88,800	1,750,248.00	0.05
473	002153	石基信息	305,300	1,749,369.00	0.05
474	002093	国脉科技	287,200	1,743,304.00	0.05
475	300248	新开普	268,300	1,741,267.00	0.05
476	688033	天宜上佳	290,208	1,741,248.00	0.05
477	002075	沙钢股份	461,100	1,738,347.00	0.05
478	603006	黎明股份	178,100	1,732,913.00	0.05
479	300123	亚光科技	369,900	1,716,336.00	0.05
480	688561	奇安信	72,467	1,711,670.54	0.05
481	002467	二六三	512,200	1,710,748.00	0.04
482	601002	晋亿实业	589,200	1,708,680.00	0.04
483	600500	中化国际	489,300	1,707,657.00	0.04
484	002017	东信和平	202,800	1,689,324.00	0.04
485	002132	恒星科技	795,800	1,687,096.00	0.04
486	300560	中富通	155,900	1,686,838.00	0.04
487	002979	雷赛智能	92,600	1,685,320.00	0.04
488	688232	新点软件	85,361	1,683,318.92	0.04
489	300035	中科电气	197,700	1,682,427.00	0.04
490	002855	捷荣技术	79,900	1,679,498.00	0.04
491	300642	透景生命	143,300	1,668,012.00	0.04
492	002689	远大智能	778,200	1,665,348.00	0.04

493	300393	中来股份	288,500	1,664,645.00	0.04
494	600228	返利科技	339,700	1,650,942.00	0.04
495	600885	宏发股份	59,500	1,646,960.00	0.04
496	000510	新金路	594,400	1,646,488.00	0.04
497	600063	皖维高新	467,100	1,644,192.00	0.04
498	002975	博杰股份	54,900	1,640,412.00	0.04
499	688055	龙腾光电	517,393	1,640,135.81	0.04
500	600691	阳煤化工	949,400	1,623,474.00	0.04
501	603577	汇金通	232,900	1,616,326.00	0.04
502	301321	翰博高新	140,370	1,615,658.70	0.04
503	688516	奥特维	38,607	1,614,158.67	0.04
504	002274	华昌化工	217,200	1,611,624.00	0.04
505	603359	东珠生态	442,900	1,607,727.00	0.04
506	603039	泛微网络	50,600	1,607,056.00	0.04
507	603982	泉峰汽车	200,200	1,601,600.00	0.04
508	300625	三雄极光	152,600	1,600,774.00	0.04
509	002955	鸿合科技	68,400	1,599,192.00	0.04
510	605228	神通科技	186,300	1,598,454.00	0.04
511	600386	北巴传媒	570,600	1,591,974.00	0.04
512	603980	吉华集团	422,100	1,578,654.00	0.04
513	603511	爱慕股份	128,400	1,576,752.00	0.04
514	002995	天地在线	119,400	1,576,080.00	0.04
515	300884	狄耐克	182,700	1,574,874.00	0.04
516	002145	中核钛白	477,600	1,566,528.00	0.04
517	600800	渤海化学	786,700	1,565,533.00	0.04
518	300571	平治信息	74,600	1,562,124.00	0.04
519	603321	梅轮电梯	228,200	1,558,606.00	0.04
520	000536	华映科技	768,000	1,551,360.00	0.04
521	600207	安彩高科	408,200	1,547,078.00	0.04
522	002148	北纬科技	332,300	1,545,195.00	0.04
523	688776	国光电气	27,866	1,543,776.40	0.04
524	688109	品茗科技	56,237	1,538,081.95	0.04
525	603155	新亚强	139,820	1,532,427.20	0.04
526	300603	立昂技术	220,800	1,525,728.00	0.04
527	002597	金禾实业	76,500	1,521,585.00	0.04
528	301069	凯盛新材	115,700	1,516,827.00	0.04
529	603038	华立股份	207,420	1,516,240.20	0.04
530	688739	成大生物	62,480	1,514,515.20	0.04
531	603615	茶花股份	143,800	1,514,214.00	0.04
532	002666	德联集团	415,400	1,503,748.00	0.04
533	603015	弘讯科技	198,800	1,502,928.00	0.04
534	688006	杭可科技	86,074	1,501,991.30	0.04
535	600110	诺德股份	489,300	1,492,365.00	0.04

536	002347	泰尔股份	392,900	1,481,233.00	0.04
537	300441	鲍斯股份	248,000	1,470,640.00	0.04
538	300074	华平股份	449,300	1,469,211.00	0.04
539	603315	福鞍股份	153,500	1,464,390.00	0.04
540	603798	康普顿	173,700	1,462,554.00	0.04
541	688788	科思科技	62,564	1,454,613.00	0.04
542	002474	榕基软件	333,400	1,453,624.00	0.04
543	300473	德尔股份	106,500	1,449,465.00	0.04
544	002190	成飞集成	102,300	1,444,476.00	0.04
545	300132	青松股份	414,600	1,442,808.00	0.04
546	000712	锦龙股份	191,400	1,435,500.00	0.04
547	002988	豪美新材	93,200	1,430,620.00	0.04
548	301308	江波龙	15,100	1,430,574.00	0.04
549	603178	圣龙股份	66,600	1,427,238.00	0.04
550	603829	洛凯股份	120,100	1,420,783.00	0.04
551	603048	浙江黎明	97,800	1,420,056.00	0.04
552	301262	海看股份	62,900	1,418,395.00	0.04
553	002645	华宏科技	222,800	1,417,008.00	0.04
554	600879	航天电子	182,100	1,414,917.00	0.04
555	603569	长久物流	205,700	1,411,102.00	0.04
556	300654	世纪天鸿	165,700	1,408,450.00	0.04
557	688078	龙软科技	61,006	1,404,968.18	0.04
558	300252	金信诺	224,000	1,400,000.00	0.04
559	605289	罗曼股份	54,900	1,394,460.00	0.04
560	603221	爱丽家居	157,000	1,392,590.00	0.04
561	603025	大豪科技	100,600	1,390,292.00	0.04
562	002993	奥海科技	37,300	1,387,560.00	0.04
563	300810	中科海讯	90,300	1,382,493.00	0.04
564	605398	新炬网络	67,100	1,374,879.00	0.04
565	603206	嘉环科技	108,700	1,372,881.00	0.04
566	603681	永冠新材	107,600	1,371,900.00	0.04
567	603917	合力科技	126,700	1,370,894.00	0.04
568	002636	金安国纪	215,300	1,367,155.00	0.04
569	688176	亚虹医药	267,316	1,365,984.76	0.04
570	300830	金现代	224,100	1,362,528.00	0.04
571	603225	新凤鸣	87,300	1,361,007.00	0.04
572	300508	维宏股份	69,600	1,352,328.00	0.04
573	688039	当虹科技	52,261	1,347,811.19	0.04
574	002960	青鸟消防	106,600	1,347,424.00	0.04
575	000546	金圆股份	335,900	1,346,959.00	0.04
576	301396	宏景科技	69,000	1,346,190.00	0.04
577	002931	锋龙股份	131,900	1,344,061.00	0.04
578	002406	远东传动	272,400	1,342,932.00	0.04

579	001278	一彬科技	84,700	1,339,107.00	0.04
580	605100	华丰股份	115,100	1,338,613.00	0.04
581	603819	神力股份	126,200	1,325,100.00	0.03
582	300011	鼎汉技术	264,500	1,319,855.00	0.03
583	600423	柳化股份	570,700	1,318,317.00	0.03
584	300986	志特新材	194,300	1,315,411.00	0.03
585	600967	内蒙一机	182,600	1,314,720.00	0.03
586	002169	智光电气	298,100	1,314,621.00	0.03
587	300701	森霸传感	156,100	1,312,801.00	0.03
588	300387	富邦股份	218,400	1,308,216.00	0.03
589	600184	光电股份	153,400	1,305,434.00	0.03
590	002885	京泉华	120,960	1,303,948.80	0.03
591	688128	中国电研	75,686	1,302,556.06	0.03
592	688737	中自科技	80,364	1,301,896.80	0.03
593	605009	豪悦护理	33,000	1,301,520.00	0.03
594	002774	快意电梯	204,700	1,299,845.00	0.03
595	300276	三丰智能	368,900	1,298,528.00	0.03
596	002164	宁波东力	337,900	1,297,536.00	0.03
597	001234	泰慕士	76,000	1,291,240.00	0.03
598	300790	宇瞳光学	95,600	1,290,600.00	0.03
599	300380	安硕信息	83,600	1,284,096.00	0.03
600	301022	海泰科	64,900	1,281,775.00	0.03
601	000626	远大控股	307,800	1,277,370.00	0.03
602	002091	江苏国泰	187,400	1,276,194.00	0.03
603	688511	天微电子	58,540	1,274,415.80	0.03
604	002863	今飞凯达	313,100	1,274,317.00	0.03
605	003005	竞业达	60,800	1,267,072.00	0.03
606	300466	赛摩智能	206,500	1,265,845.00	0.03
607	688660	电气风电	437,143	1,258,971.84	0.03
608	300464	星徽股份	357,000	1,256,640.00	0.03
609	002403	爱仕达	189,700	1,255,814.00	0.03
610	002189	中光学	90,000	1,254,600.00	0.03
611	600335	国机汽车	217,200	1,253,244.00	0.03
612	002753	永东股份	215,307	1,250,933.67	0.03
613	605288	凯迪股份	40,400	1,250,784.00	0.03
614	000837	秦川机床	169,900	1,250,464.00	0.03
615	300422	博世科	262,700	1,250,452.00	0.03
616	002912	中新赛克	70,400	1,247,488.00	0.03
617	603956	威派格	234,200	1,243,602.00	0.03
618	603121	华培动力	174,600	1,243,152.00	0.03
619	300694	蠡湖股份	145,500	1,238,205.00	0.03
620	603041	美思德	122,843	1,228,430.00	0.03
621	603166	福达股份	249,700	1,223,530.00	0.03

622	001207	联科科技	84,100	1,221,132.00	0.03
623	300414	中光防雷	184,700	1,220,867.00	0.03
624	603790	雅运股份	126,900	1,218,240.00	0.03
625	688280	精进电动	299,317	1,218,220.19	0.03
626	300850	新强联	80,900	1,215,118.00	0.03
627	600735	新华锦	317,100	1,214,493.00	0.03
628	688375	国博电子	17,178	1,213,453.92	0.03
629	600676	交运股份	436,100	1,207,997.00	0.03
630	688066	航天宏图	67,839	1,207,534.20	0.03
631	300707	威唐工业	97,400	1,205,812.00	0.03
632	300615	欣天科技	125,600	1,201,992.00	0.03
633	300565	科信技术	119,200	1,197,960.00	0.03
634	002546	新联电子	368,500	1,197,625.00	0.03
635	688228	开普云	31,366	1,196,926.56	0.03
636	688357	建龙微纳	51,297	1,195,220.10	0.03
637	002512	达华智能	346,000	1,193,700.00	0.03
638	300291	百纳千成	280,000	1,192,800.00	0.03
639	605218	伟时电子	73,700	1,190,255.00	0.03
640	603238	诺邦股份	119,200	1,187,232.00	0.03
641	600218	全柴动力	176,800	1,186,328.00	0.03
642	301020	密封科技	74,800	1,183,336.00	0.03
643	301291	明阳电气	39,300	1,180,965.00	0.03
644	300504	天邑股份	96,800	1,179,992.00	0.03
645	688291	金橙子	68,224	1,174,817.28	0.03
646	301510	固高科技	42,200	1,171,050.00	0.03
647	300259	新天科技	462,500	1,170,125.00	0.03
648	002866	传艺科技	90,700	1,167,309.00	0.03
649	603988	中电电机	149,440	1,167,126.40	0.03
650	300562	乐心医疗	130,800	1,165,428.00	0.03
651	300871	回盛生物	122,100	1,164,834.00	0.03
652	605122	四方新材	119,700	1,163,484.00	0.03
653	002451	摩恩电气	216,300	1,161,531.00	0.03
654	603916	苏博特	173,100	1,161,501.00	0.03
655	688315	诺禾致源	106,360	1,161,451.20	0.03
656	301313	凡拓数创	56,800	1,155,880.00	0.03
657	300578	会畅通讯	78,000	1,154,400.00	0.03
658	000058	深赛格	214,900	1,154,013.00	0.03
659	603385	惠达卫浴	210,100	1,153,449.00	0.03
660	300176	派生科技	261,500	1,153,215.00	0.03
661	601069	西部黄金	98,900	1,150,207.00	0.03
662	002860	星帅尔	140,400	1,149,876.00	0.03
663	688669	聚石化学	101,386	1,147,689.52	0.03
664	300409	道氏技术	133,500	1,142,760.00	0.03



665	603536	惠发食品	143,800	1,137,458.00	0.03
666	002272	川润股份	253,700	1,136,576.00	0.03
667	300978	东箭科技	123,000	1,135,290.00	0.03
668	300261	雅本化学	214,200	1,135,260.00	0.03
669	600476	湘邮科技	93,700	1,124,400.00	0.03
670	300095	华伍股份	203,100	1,119,081.00	0.03
671	300001	特锐德	55,400	1,114,648.00	0.03
672	002184	海得控制	124,100	1,114,418.00	0.03
673	002441	众业达	147,000	1,114,260.00	0.03
674	003027	同兴环保	89,800	1,104,540.00	0.03
675	603122	合富中国	215,900	1,098,931.00	0.03
676	603028	赛福天	194,900	1,097,287.00	0.03
677	002465	海格通信	105,900	1,097,124.00	0.03
678	600288	大恒科技	168,300	1,095,633.00	0.03
679	603585	苏利股份	112,206	1,095,130.56	0.03
680	603123	翠微股份	183,600	1,090,584.00	0.03
681	300065	海兰信	164,900	1,089,989.00	0.03
682	300953	震裕科技	20,000	1,084,000.00	0.03
683	603378	亚士创能	214,100	1,083,346.00	0.03
684	301209	联合化学	49,400	1,081,860.00	0.03
685	605255	天普股份	90,000	1,081,800.00	0.03
686	000533	顺钠股份	327,200	1,076,488.00	0.03
687	688160	步科股份	26,890	1,075,331.10	0.03
688	600055	万东医疗	86,900	1,073,215.00	0.03
689	000599	青岛双星	303,500	1,071,355.00	0.03
690	600356	恒丰纸业	180,300	1,067,376.00	0.03
691	603330	天洋新材	222,000	1,063,380.00	0.03
692	002662	京威股份	349,700	1,063,088.00	0.03
693	688551	科威尔	33,724	1,062,306.00	0.03
694	300230	永利股份	315,900	1,061,424.00	0.03
695	002434	万里扬	216,400	1,060,360.00	0.03
696	600526	菲达环保	285,800	1,060,318.00	0.03
697	002514	宝馨科技	256,000	1,057,280.00	0.03
698	002054	德美化工	214,900	1,055,159.00	0.03
699	603201	常润股份	43,600	1,055,120.00	0.03
700	300099	尤洛卡	231,900	1,052,826.00	0.03
701	600678	四川金顶	201,800	1,051,378.00	0.03
702	002782	可立克	94,700	1,049,276.00	0.03
703	688179	阿拉丁	108,300	1,047,261.00	0.03
704	688181	八亿时空	55,192	1,045,888.40	0.03
705	603818	曲美家居	374,300	1,044,297.00	0.03
706	002576	通达动力	92,000	1,044,200.00	0.03
707	688596	正帆科技	31,641	1,044,153.00	0.03

708	688369	致远互联	66,273	1,042,474.29	0.03
709	002122	汇洲智能	498,000	1,040,820.00	0.03
710	605050	福然德	118,100	1,040,461.00	0.03
711	600097	开创国际	126,200	1,038,626.00	0.03
712	001268	联合精密	61,100	1,034,423.00	0.03
713	300691	联合光电	68,600	1,032,430.00	0.03
714	300440	运达科技	196,600	1,032,150.00	0.03
715	600636	国新文化	137,400	1,030,500.00	0.03
716	688165	埃夫特	131,595	1,029,072.90	0.03
717	688787	海天瑞声	18,703	1,026,420.64	0.03
718	603683	晶华新材	129,000	1,024,260.00	0.03
719	002957	科瑞技术	75,500	1,023,780.00	0.03
720	603662	柯力传感	43,800	1,022,292.00	0.03
721	603196	日播时尚	144,700	1,021,582.00	0.03
722	603999	读者传媒	214,400	1,014,112.00	0.03
723	002558	巨人网络	107,400	1,013,856.00	0.03
724	002972	科安达	110,300	1,010,348.00	0.03
725	300173	福能东方	267,300	1,007,721.00	0.03
726	002175	东方智造	572,400	1,007,424.00	0.03
727	605369	拱东医疗	25,200	1,005,480.00	0.03
728	000997	新大陆	72,100	1,002,911.00	0.03
729	301378	通达海	46,060	999,502.00	0.03
730	603089	正裕工业	119,500	999,020.00	0.03
731	603987	康德莱	162,600	993,486.00	0.03
732	300082	奥克股份	232,900	992,154.00	0.03
733	301380	挖金客	30,900	990,036.00	0.03
734	603258	电魂网络	61,300	989,995.00	0.03
735	688186	广大特材	101,710	989,638.30	0.03
736	300912	凯龙高科	105,600	989,472.00	0.03
737	002337	赛象科技	260,000	988,000.00	0.03
738	002520	日发精机	260,000	985,400.00	0.03
739	600819	耀皮玻璃	233,200	984,104.00	0.03
740	300549	优德精密	72,500	980,200.00	0.03
741	603233	大参林	68,500	979,550.00	0.03
742	603116	红蜻蜓	217,400	978,300.00	0.03
743	603429	集友股份	235,300	976,495.00	0.03
744	300161	华中数控	43,200	971,568.00	0.03
745	300375	鹏翎股份	250,900	970,983.00	0.03
746	600540	新赛股份	284,700	970,827.00	0.03
747	603303	得邦照明	84,300	967,764.00	0.03
748	002137	实益达	203,000	966,280.00	0.03
749	603211	晋拓股份	70,300	963,813.00	0.03
750	600525	长园集团	226,100	963,186.00	0.03

751	603682	锦和商管	238,800	952,812.00	0.03
752	600468	百利电气	219,200	944,752.00	0.02
753	603855	华荣股份	42,700	944,097.00	0.02
754	300112	万讯自控	136,600	942,540.00	0.02
755	603192	汇得科技	69,900	938,757.00	0.02
756	002297	博云新材	156,200	937,200.00	0.02
757	601678	滨化股份	267,700	931,596.00	0.02
758	603968	醋化股份	93,800	930,496.00	0.02
759	001206	依依股份	71,100	925,722.00	0.02
760	603538	美诺华	82,800	924,876.00	0.02
761	300024	机器人	94,500	920,430.00	0.02
762	301056	森赫股份	119,700	918,099.00	0.02
763	002026	山东威达	110,600	917,980.00	0.02
764	300269	联建光电	364,600	915,146.00	0.02
765	002849	威星智能	81,600	910,656.00	0.02
766	300410	正业科技	177,800	910,336.00	0.02
767	688432	有研硅	93,593	906,916.17	0.02
768	300522	世名科技	82,000	906,100.00	0.02
769	605158	华达新材	140,800	905,344.00	0.02
770	300605	恒锋信息	99,600	902,376.00	0.02
771	603703	盛洋科技	89,600	898,688.00	0.02
772	688283	坤恒顺维	26,122	898,074.36	0.02
773	688170	德龙激光	40,738	897,050.76	0.02
774	603366	日出东方	251,000	896,070.00	0.02
775	000045	深纺织 A	111,700	895,834.00	0.02
776	000678	襄阳轴承	238,200	895,632.00	0.02
777	301133	金钟股份	41,100	895,569.00	0.02
778	300055	万邦达	221,000	895,050.00	0.02
779	603656	泰禾智能	82,100	891,606.00	0.02
780	603032	德新科技	78,000	891,540.00	0.02
781	603488	展鹏科技	130,900	890,120.00	0.02
782	601326	秦港股份	280,300	888,551.00	0.02
783	688237	超卓航科	44,255	887,312.75	0.02
784	603903	中持股份	126,500	886,765.00	0.02
785	301157	华塑科技	27,200	886,720.00	0.02
786	600012	皖通高速	63,400	885,698.00	0.02
787	300780	德恩精工	65,500	883,595.00	0.02
788	688323	瑞华泰	87,703	883,169.21	0.02
789	300800	力合科技	85,200	882,672.00	0.02
790	688330	宏力达	43,270	882,275.30	0.02
791	301155	海力风电	21,900	881,037.00	0.02
792	002686	亿利达	209,800	879,062.00	0.02
793	600936	广西广电	432,600	873,852.00	0.02

794	003022	联泓新科	63,600	871,956.00	0.02
795	605033	美邦股份	70,200	871,884.00	0.02
796	300235	方直科技	108,300	868,566.00	0.02
797	300131	英唐智控	195,000	867,750.00	0.02
798	300959	线上线下	30,800	865,788.00	0.02
799	301213	观想科技	31,700	865,727.00	0.02
800	300120	经纬辉开	166,600	864,654.00	0.02
801	300895	铜牛信息	34,800	864,084.00	0.02
802	002387	维信诺	142,100	863,968.00	0.02
803	301051	信濠光电	32,900	862,967.00	0.02
804	300241	瑞丰光电	209,800	860,180.00	0.02
805	301365	矩阵股份	77,800	855,022.00	0.02
806	300448	浩云科技	203,400	852,246.00	0.02
807	002214	大立科技	75,300	849,384.00	0.02
808	000639	西王食品	356,500	848,470.00	0.02
809	603677	奇精机械	72,800	848,120.00	0.02
810	300599	雄塑科技	170,400	846,888.00	0.02
811	002858	力盛体育	81,200	844,480.00	0.02
812	688616	西力科技	74,435	844,092.90	0.02
813	002286	保龄宝	153,000	843,030.00	0.02
814	688510	航亚科技	45,724	841,778.84	0.02
815	603216	梦天家居	91,100	836,298.00	0.02
816	000701	厦门信达	222,800	833,272.00	0.02
817	300657	弘信电子	55,400	832,108.00	0.02
818	300491	通合科技	57,900	831,444.00	0.02
819	300899	上海凯鑫	44,700	830,526.00	0.02
820	300942	易瑞生物	138,400	829,016.00	0.02
821	000703	恒逸石化	116,800	828,112.00	0.02
822	300148	天舟文化	357,700	826,287.00	0.02
823	300949	奥雅股份	27,700	825,737.00	0.02
824	603086	先达股份	216,800	823,840.00	0.02
825	300512	中亚股份	139,000	822,880.00	0.02
826	000635	英力特	139,700	817,245.00	0.02
827	300802	矩子科技	51,700	815,309.00	0.02
828	301003	江苏博云	37,900	815,229.00	0.02
829	301117	佳缘科技	31,500	812,700.00	0.02
830	603336	宏辉果蔬	269,600	811,496.00	0.02
831	603096	新经典	48,000	811,200.00	0.02
832	002405	四维图新	130,200	809,844.00	0.02
833	688010	福光股份	51,964	809,079.48	0.02
834	603299	苏盐井神	85,100	808,450.00	0.02
835	002213	大为股份	82,800	807,300.00	0.02
836	000925	众合科技	122,600	806,708.00	0.02

837	603839	安正时尚	184,400	805,828.00	0.02
838	600215	派斯林	113,000	805,690.00	0.02
839	603331	百达精工	88,600	803,602.00	0.02
840	002682	龙洲股份	225,100	801,356.00	0.02
841	001287	中电港	48,400	800,052.00	0.02
842	603326	我乐家居	143,700	798,972.00	0.02
843	300683	海特生物	37,700	797,732.00	0.02
844	300371	汇中股份	95,300	797,661.00	0.02
845	603933	睿能科技	62,000	797,320.00	0.02
846	002769	普路通	152,200	796,006.00	0.02
847	300980	祥源新材	50,500	795,880.00	0.02
848	300809	华辰装备	39,200	794,192.00	0.02
849	301045	天禄科技	41,600	792,896.00	0.02
850	300854	中兰环保	79,300	788,242.00	0.02
851	002796	世嘉科技	99,100	787,845.00	0.02
852	300610	晨化股份	89,800	787,546.00	0.02
853	688147	微导纳米	31,620	787,338.00	0.02
854	003036	泰坦股份	98,300	785,417.00	0.02
855	301052	果麦文化	38,300	785,150.00	0.02
856	603195	公牛集团	10,125	780,840.00	0.02
857	300535	达威股份	66,000	778,800.00	0.02
858	603948	建业股份	47,800	778,184.00	0.02
859	002825	纳尔股份	124,800	777,504.00	0.02
860	002224	三力士	201,800	776,930.00	0.02
861	301066	万事利	95,900	776,790.00	0.02
862	000576	甘化科工	129,400	776,400.00	0.02
863	002980	华盛昌	35,400	774,906.00	0.02
864	300853	申昊科技	53,200	773,528.00	0.02
865	603109	神驰机电	59,000	773,490.00	0.02
866	603520	司太立	80,800	770,832.00	0.02
867	001209	洪兴股份	55,800	770,040.00	0.02
868	300399	天利科技	87,600	770,004.00	0.02
869	002082	万邦德	182,400	767,904.00	0.02
870	002870	香山股份	25,700	766,631.00	0.02
871	600718	东软集团	92,600	765,802.00	0.02
872	300860	锋尚文化	36,300	763,752.00	0.02
873	001317	三羊马	32,500	763,425.00	0.02
874	605006	山东玻纤	171,720	757,285.20	0.02
875	688387	信科移动	150,117	756,589.68	0.02
876	002161	远望谷	163,400	754,908.00	0.02
877	300299	富春股份	217,400	754,378.00	0.02
878	001223	欧克科技	21,400	753,066.00	0.02
879	300154	瑞凌股份	141,000	751,530.00	0.02

880	601011	宝泰隆	468,900	750,240.00	0.02
881	002065	东华软件	165,400	747,608.00	0.02
882	300509	新美星	158,800	743,184.00	0.02
883	688257	新锐股份	48,191	738,768.03	0.02
884	603158	腾龙股份	104,600	736,384.00	0.02
885	603601	再升科技	264,500	730,020.00	0.02
886	301222	浙江恒威	29,400	727,944.00	0.02
887	601700	风范股份	164,400	721,716.00	0.02
888	002961	瑞达期货	65,900	721,605.00	0.02
889	002585	双星新材	145,000	719,200.00	0.02
890	002949	华阳国际	76,400	718,924.00	0.02
891	600698	湖南天雁	211,700	717,663.00	0.02
892	601607	上海医药	37,300	712,803.00	0.02
893	002852	道道全	99,000	712,800.00	0.02
894	301528	多浦乐	16,600	711,144.00	0.02
895	300018	中元股份	153,400	705,640.00	0.02
896	600963	岳阳林纸	192,200	705,374.00	0.02
897	000738	航发控制	35,100	704,457.00	0.02
898	300471	厚普股份	89,000	701,320.00	0.02
899	002565	顺灏股份	292,700	699,553.00	0.02
900	688168	安博通	25,918	697,194.20	0.02
901	688380	中微半导	41,520	694,214.40	0.02
902	600668	尖峰集团	86,700	689,265.00	0.02
903	301122	采纳股份	36,500	687,295.00	0.02
904	605168	三人行	26,100	687,213.00	0.02
905	688178	万德斯	66,590	686,542.90	0.02
906	600408	安泰集团	433,600	685,088.00	0.02
907	603235	天新药业	28,500	684,855.00	0.02
908	002664	信质集团	57,300	681,870.00	0.02
909	600272	开开实业	79,000	679,400.00	0.02
910	000633	合金投资	172,400	679,256.00	0.02
911	002480	新筑股份	216,700	676,104.00	0.02
912	002795	永和智控	181,100	673,692.00	0.02
913	002109	兴化股份	207,900	669,438.00	0.02
914	600939	重庆建工	288,300	668,856.00	0.02
915	301072	中捷精工	33,500	665,980.00	0.02
916	688370	丛麟科技	41,640	664,574.40	0.02
917	002631	德尔未来	185,300	663,374.00	0.02
918	002617	露笑科技	138,200	663,360.00	0.02
919	603579	荣泰健康	42,500	657,050.00	0.02
920	603176	汇通集团	175,900	656,107.00	0.02
921	002084	海鸥住工	267,700	655,865.00	0.02
922	300840	酷特智能	70,700	653,975.00	0.02

923	688110	东芯股份	34,249	653,128.43	0.02
924	301268	铭利达	42,000	653,100.00	0.02
925	300870	欧陆通	15,000	650,700.00	0.02
926	688060	云涌科技	20,307	650,636.28	0.02
927	600350	山东高速	72,900	645,165.00	0.02
928	300665	飞鹿股份	127,200	644,904.00	0.02
929	603969	银龙股份	130,000	644,800.00	0.02
930	688685	迈信林	26,353	644,330.85	0.02
931	601908	京运通	253,900	642,367.00	0.02
932	300996	普联软件	43,500	638,145.00	0.02
933	688348	昱能科技	10,805	637,495.00	0.02
934	603529	爱玛科技	23,200	634,056.00	0.02
935	600665	天地源	285,200	633,144.00	0.02
936	688538	和辉光电	319,188	631,992.24	0.02
937	603065	宿迁联盛	84,000	627,480.00	0.02
938	603090	宏盛股份	35,200	627,264.00	0.02
939	300263	隆华科技	111,600	624,960.00	0.02
940	301148	嘉戎技术	35,200	623,040.00	0.02
941	600756	浪潮软件	61,500	621,150.00	0.02
942	300370	安控科技	383,400	621,108.00	0.02
943	000050	深天马 A	85,100	619,528.00	0.02
944	002479	富春环保	175,900	619,168.00	0.02
945	603811	诚意药业	98,600	616,250.00	0.02
946	301032	新柴股份	90,900	609,939.00	0.02
947	601388	怡球资源	277,700	608,163.00	0.02
948	600784	鲁银投资	126,800	601,032.00	0.02
949	002375	亚厦股份	184,900	600,925.00	0.02
950	605507	国邦医药	36,000	599,400.00	0.02
951	605189	富春染织	56,200	599,092.00	0.02
952	301028	东亚机械	68,200	598,114.00	0.02
953	002282	博深股份	93,100	594,909.00	0.02
954	600731	湖南海利	127,300	588,126.00	0.02
955	603286	日盈电子	36,700	584,631.00	0.02
956	003012	东鹏控股	95,500	583,505.00	0.02
957	300635	中达安	77,200	582,860.00	0.02
958	300363	博腾股份	48,700	581,965.00	0.02
959	300773	拉卡拉	46,600	579,238.00	0.02
960	301330	熵基科技	25,700	577,736.00	0.02
961	688509	正元地信	199,900	577,711.00	0.02
962	301055	张小泉	48,700	577,582.00	0.02
963	600186	莲花控股	167,900	575,897.00	0.02
964	300222	科大智能	107,400	575,664.00	0.02
965	002658	雪迪龙	112,000	574,560.00	0.02

966	300879	大叶股份	42,900	574,002.00	0.02
967	300883	龙利得	134,900	570,627.00	0.02
968	002418	康盛股份	301,100	569,079.00	0.01
969	002942	新农股份	48,000	565,920.00	0.01
970	002575	群兴玩具	128,600	565,840.00	0.01
971	300987	川网传媒	46,600	565,724.00	0.01
972	688003	天淮科技	17,213	563,897.88	0.01
973	002692	远程股份	168,100	563,135.00	0.01
974	600035	楚天高速	131,100	562,419.00	0.01
975	605500	森林包装	91,400	562,110.00	0.01
976	001308	康冠科技	24,900	560,250.00	0.01
977	603758	秦安股份	72,600	551,760.00	0.01
978	001260	坤泰股份	39,100	544,663.00	0.01
979	603077	和邦生物	328,500	542,025.00	0.01
980	301198	喜悦智行	67,077	537,286.77	0.01
981	300329	海伦钢琴	142,400	536,848.00	0.01
982	002685	华东重机	228,400	536,740.00	0.01
983	600740	山西焦化	136,100	533,512.00	0.01
984	600420	国药现代	49,900	532,932.00	0.01
985	688418	震有科技	31,096	532,674.48	0.01
986	301009	可靠股份	70,900	529,623.00	0.01
987	002830	名雕股份	53,800	529,392.00	0.01
988	300931	通用电梯	96,500	528,820.00	0.01
989	600523	贵航股份	53,400	528,660.00	0.01
990	300426	唐德影视	77,900	528,162.00	0.01
991	603012	创力集团	117,900	525,834.00	0.01
992	688316	青云科技	17,575	525,668.25	0.01
993	000550	江铃汽车	24,200	525,382.00	0.01
994	002494	华斯股份	168,100	524,472.00	0.01
995	002671	龙泉股份	145,000	520,550.00	0.01
996	600615	丰华股份	61,500	520,290.00	0.01
997	002329	皇氏集团	191,500	518,965.00	0.01
998	003007	直真科技	20,800	518,960.00	0.01
999	301075	多瑞医药	32,600	518,340.00	0.01
1,000	603045	福达合金	51,700	513,381.00	0.01
1,001	688113	联测科技	18,085	513,071.45	0.01
1,002	688503	聚和材料	18,257	513,021.70	0.01
1,003	600860	京城股份	63,500	512,445.00	0.01
1,004	300510	金冠股份	143,700	502,950.00	0.01
1,005	301010	晶雪节能	43,600	501,836.00	0.01
1,006	300640	德艺文创	127,300	501,562.00	0.01
1,007	301298	东利机械	38,900	495,975.00	0.01
1,008	002873	新天药业	59,700	495,510.00	0.01



1,009	603967	中创物流	52,600	489,180.00	0.01
1,010	601999	出版传媒	93,500	488,070.00	0.01
1,011	002103	广博股份	98,300	487,568.00	0.01
1,012	600961	株冶集团	51,500	486,160.00	0.01
1,013	300587	天铁股份	119,900	484,396.00	0.01
1,014	603053	成都燃气	50,000	483,000.00	0.01
1,015	605555	德昌股份	25,900	481,999.00	0.01
1,016	300143	盈康生命	64,000	481,920.00	0.01
1,017	002730	电光科技	68,200	480,128.00	0.01
1,018	603323	苏农银行	99,600	479,076.00	0.01
1,019	000887	中鼎股份	39,000	477,360.00	0.01
1,020	603912	佳力图	79,100	474,600.00	0.01
1,021	688201	信安世纪	40,069	473,214.89	0.01
1,022	300550	和仁科技	49,900	471,555.00	0.01
1,023	300981	中红医疗	49,200	470,844.00	0.01
1,024	300126	锐奇股份	103,600	469,308.00	0.01
1,025	000717	中南股份	277,600	469,144.00	0.01
1,026	301006	迈拓股份	40,000	467,600.00	0.01
1,027	003003	天元股份	58,400	465,448.00	0.01
1,028	002524	光正眼科	147,700	465,255.00	0.01
1,029	600446	金证股份	46,800	464,724.00	0.01
1,030	002265	建设工业	53,500	461,705.00	0.01
1,031	300877	金春股份	42,500	460,700.00	0.01
1,032	603630	拉芳家化	43,700	459,287.00	0.01
1,033	603181	皇马科技	50,800	456,692.00	0.01
1,034	002245	蔚蓝锂芯	58,900	456,475.00	0.01
1,035	603689	皖天然气	55,200	453,744.00	0.01
1,036	002429	兆驰股份	93,600	450,216.00	0.01
1,037	600467	好当家	315,100	447,442.00	0.01
1,038	300892	品渥食品	32,700	446,028.00	0.01
1,039	603022	新通联	61,200	445,536.00	0.01
1,040	301040	中环海陆	44,800	443,968.00	0.01
1,041	605566	福莱蒾特	29,000	441,670.00	0.01
1,042	301098	金埔园林	57,900	438,303.00	0.01
1,043	300528	幸福蓝海	69,600	437,088.00	0.01
1,044	600539	狮头股份	119,900	436,436.00	0.01
1,045	002591	恒大高新	118,600	434,076.00	0.01
1,046	600470	六国化工	111,900	427,458.00	0.01
1,047	300828	锐新科技	35,700	423,759.00	0.01
1,048	601956	东贝集团	92,100	421,818.00	0.01
1,049	600722	金牛化工	111,100	421,069.00	0.01
1,050	002295	精艺股份	79,100	420,812.00	0.01
1,051	000663	永安林业	100,400	420,676.00	0.01

1,052	600099	林海股份	61,100	420,368.00	0.01
1,053	000059	华锦股份	99,800	418,162.00	0.01
1,054	600455	博通股份	28,400	418,048.00	0.01
1,055	600241	时代万恒	74,900	416,444.00	0.01
1,056	688681	科汇股份	40,287	411,330.27	0.01
1,057	300746	汉嘉设计	65,300	410,084.00	0.01
1,058	600167	联美控股	78,500	408,985.00	0.01
1,059	300838	浙江力诺	39,700	408,116.00	0.01
1,060	300582	英飞特	47,600	407,456.00	0.01
1,061	300935	盈建科	26,200	406,362.00	0.01
1,062	603309	维力医疗	36,900	406,269.00	0.01
1,063	301025	读客文化	40,500	404,595.00	0.01
1,064	002534	西子洁能	40,400	404,404.00	0.01
1,065	300389	艾比森	32,600	400,328.00	0.01
1,066	002589	瑞康医药	181,700	399,740.00	0.01
1,067	300886	华业香料	24,200	397,364.00	0.01
1,068	688011	新光光电	26,173	396,520.95	0.01
1,069	601872	招商轮船	46,900	396,305.00	0.01
1,070	688135	利扬芯片	24,688	395,501.76	0.01
1,071	301419	阿莱德	15,900	394,797.00	0.01
1,072	300658	延江股份	92,900	392,038.00	0.01
1,073	301002	崧盛股份	23,200	391,384.00	0.01
1,074	600156	华升股份	125,600	390,616.00	0.01
1,075	301111	粤万年青	27,900	389,205.00	0.01
1,076	688379	华光新材	28,263	387,485.73	0.01
1,077	600380	健康元	34,600	386,482.00	0.01
1,078	605056	咸亨国际	35,600	383,768.00	0.01
1,079	300267	尔康制药	184,200	383,136.00	0.01
1,080	688002	睿创微纳	13,662	382,126.14	0.01
1,081	603727	博迈科	29,000	381,640.00	0.01
1,082	300405	科隆股份	107,400	381,270.00	0.01
1,083	600448	华纺股份	193,200	380,604.00	0.01
1,084	600730	中国高科	94,900	378,651.00	0.01
1,085	301273	瑞晨环保	24,300	378,351.00	0.01
1,086	300823	建科智能	31,100	377,865.00	0.01
1,087	300591	万里马	120,400	375,648.00	0.01
1,088	001236	弘业期货	52,600	373,986.00	0.01
1,089	002723	小崧股份	59,500	373,065.00	0.01
1,090	002809	红墙股份	51,900	372,123.00	0.01
1,091	600965	福成股份	102,100	371,644.00	0.01
1,092	688322	奥比中光	13,880	370,734.80	0.01
1,093	688277	天智航	47,799	369,964.26	0.01
1,094	000088	盐田港	81,300	368,289.00	0.01

1,095	603648	畅联股份	46,500	368,280.00	0.01
1,096	603183	建研院	114,200	366,582.00	0.01
1,097	688475	萤石网络	10,627	362,486.97	0.01
1,098	603399	吉翔股份	58,400	361,496.00	0.01
1,099	603272	联翔股份	42,500	361,250.00	0.01
1,100	600243	青海华鼎	133,400	358,846.00	0.01
1,101	000545	金浦钛业	216,000	358,560.00	0.01
1,102	003040	楚天龙	29,100	357,930.00	0.01
1,103	600235	民丰特纸	77,800	357,880.00	0.01
1,104	688395	正弦电气	25,037	356,777.25	0.01
1,105	603680	今创集团	54,000	356,400.00	0.01
1,106	603687	大胜达	49,500	354,420.00	0.01
1,107	603810	丰山集团	42,200	352,792.00	0.01
1,108	002152	广电运通	33,700	352,502.00	0.01
1,109	605259	绿田机械	18,000	351,180.00	0.01
1,110	605001	威奥股份	72,000	350,640.00	0.01
1,111	002643	万润股份	34,900	349,000.00	0.01
1,112	300564	筑博设计	40,900	348,877.00	0.01
1,113	002088	鲁阳节能	28,700	346,983.00	0.01
1,114	601828	美凯龙	133,300	339,915.00	0.01
1,115	600689	上海三毛	50,200	338,850.00	0.01
1,116	603978	深圳新星	37,700	337,415.00	0.01
1,117	002638	勤上股份	224,900	335,101.00	0.01
1,118	688215	瑞晟智能	14,197	334,907.23	0.01
1,119	601599	浙文影业	116,100	334,368.00	0.01
1,120	603281	江瀚新材	14,800	332,260.00	0.01
1,121	600847	万里股份	52,300	332,105.00	0.01
1,122	002722	物产金轮	29,200	329,960.00	0.01
1,123	603939	益丰药房	13,360	327,988.00	0.01
1,124	603214	爱婴室	28,800	325,152.00	0.01
1,125	600609	金杯汽车	93,500	324,445.00	0.01
1,126	300789	唐源电气	24,435	323,519.40	0.01
1,127	603256	宏和科技	45,800	323,348.00	0.01
1,128	600551	时代出版	45,600	322,848.00	0.01
1,129	688067	爱威科技	22,387	321,253.45	0.01
1,130	300242	佳云科技	192,200	320,974.00	0.01
1,131	600352	浙江龙盛	37,200	319,548.00	0.01
1,132	688079	美迪凯	42,987	318,963.54	0.01
1,133	600051	宁波联合	60,400	318,308.00	0.01
1,134	688600	皖仪科技	23,705	316,935.85	0.01
1,135	301288	清研环境	28,300	315,828.00	0.01
1,136	300955	嘉亨家化	24,900	315,483.00	0.01
1,137	688189	南新制药	55,986	315,201.18	0.01

1,138	605068	明新旭腾	23,800	313,684.00	0.01
1,139	600433	冠豪高新	116,500	308,725.00	0.01
1,140	600880	博瑞传播	81,900	307,944.00	0.01
1,141	688171	纬德信息	20,310	306,274.80	0.01
1,142	600232	金鹰股份	70,900	305,579.00	0.01
1,143	600657	信达地产	100,000	305,000.00	0.01
1,144	605389	长龄液压	14,500	304,355.00	0.01
1,145	300384	三联虹普	22,900	300,448.00	0.01
1,146	600619	海立股份	58,000	299,860.00	0.01
1,147	603159	上海亚虹	28,800	299,808.00	0.01
1,148	605018	长华集团	33,000	298,980.00	0.01
1,149	300902	国安达	15,040	298,844.80	0.01
1,150	600710	苏美达	36,500	297,475.00	0.01
1,151	688163	赛伦生物	24,451	296,835.14	0.01
1,152	605303	园林股份	44,300	296,810.00	0.01
1,153	300749	顶固集创	55,200	292,560.00	0.01
1,154	688433	华曙高科	13,946	290,913.56	0.01
1,155	605007	五洲特纸	23,000	290,490.00	0.01
1,156	603329	上海雅仕	26,300	289,826.00	0.01
1,157	603085	天成自控	32,000	286,080.00	0.01
1,158	688162	巨一科技	14,527	282,985.96	0.01
1,159	002022	科华生物	49,600	280,240.00	0.01
1,160	603167	渤海轮渡	34,200	279,414.00	0.01
1,161	002674	兴业科技	27,300	279,006.00	0.01
1,162	300584	海辰药业	18,200	277,186.00	0.01
1,163	603861	白云电器	33,100	277,047.00	0.01
1,164	688081	兴图新科	31,471	276,944.80	0.01
1,165	300111	向日葵	147,600	276,012.00	0.01
1,166	603955	大千生态	32,000	275,200.00	0.01
1,167	300334	津膜科技	58,800	275,184.00	0.01
1,168	600478	科力远	72,700	274,079.00	0.01
1,169	600808	马钢股份	134,900	272,498.00	0.01
1,170	600319	亚星化学	82,300	272,413.00	0.01
1,171	605366	宏柏新材	46,600	270,746.00	0.01
1,172	600128	苏豪弘业	42,500	270,725.00	0.01
1,173	688403	汇成股份	31,906	270,562.88	0.01
1,174	603788	宁波高发	22,000	270,160.00	0.01
1,175	300611	美力科技	35,400	269,748.00	0.01
1,176	002577	雷柏科技	21,800	269,666.00	0.01
1,177	603928	兴业股份	34,270	268,334.10	0.01
1,178	688229	博睿数据	10,419	267,976.68	0.01
1,179	605055	迎丰股份	65,600	266,992.00	0.01
1,180	600493	凤竹纺织	61,300	266,655.00	0.01

1,181	301113	雅艺科技	13,400	266,526.00	0.01
1,182	603686	福龙马	34,900	265,938.00	0.01
1,183	605133	嵘泰股份	14,500	265,785.00	0.01
1,184	688026	洁特生物	26,685	265,782.60	0.01
1,185	600768	宁波富邦	37,800	264,978.00	0.01
1,186	002531	天顺风能	29,600	264,624.00	0.01
1,187	002718	友邦吊顶	25,200	263,088.00	0.01
1,188	603177	德创环保	37,200	261,516.00	0.01
1,189	300478	杭州高新	33,500	261,300.00	0.01
1,190	002062	宏润建设	74,800	260,304.00	0.01
1,191	301065	本立科技	16,100	255,990.00	0.01
1,192	603213	镇洋发展	34,200	255,816.00	0.01
1,193	600180	瑞茂通	66,900	254,889.00	0.01
1,194	600561	江西长运	69,800	254,072.00	0.01
1,195	002630	华西能源	119,200	252,704.00	0.01
1,196	688227	品高股份	20,823	252,166.53	0.01
1,197	688683	莱尔科技	15,641	250,412.41	0.01
1,198	603876	鼎胜新材	26,300	243,801.00	0.01
1,199	605183	确成股份	15,700	242,722.00	0.01
1,200	600081	东风科技	27,700	242,375.00	0.01
1,201	002996	顺博合金	41,200	241,020.00	0.01
1,202	600928	西安银行	73,700	240,999.00	0.01
1,203	002522	浙江众成	75,800	239,528.00	0.01
1,204	601998	中信银行	35,700	239,190.00	0.01
1,205	002177	御银股份	73,900	238,697.00	0.01
1,206	601279	英利汽车	63,900	238,347.00	0.01
1,207	600137	浪莎股份	19,700	233,839.00	0.01
1,208	603637	镇海股份	38,100	232,410.00	0.01
1,209	603033	三维股份	19,800	231,660.00	0.01
1,210	002097	山河智能	38,000	229,140.00	0.01
1,211	301317	鑫磊股份	14,700	228,438.00	0.01
1,212	300929	华骐环保	31,200	228,384.00	0.01
1,213	300006	莱美药业	96,900	226,746.00	0.01
1,214	002391	长青股份	49,800	225,096.00	0.01
1,215	603655	朗博科技	15,100	223,782.00	0.01
1,216	002571	德力股份	45,300	220,611.00	0.01
1,217	603112	华翔股份	20,900	219,659.00	0.01
1,218	300257	开山股份	21,700	219,170.00	0.01
1,219	688021	奥福环保	23,664	217,708.80	0.01
1,220	688528	秦川物联	27,016	215,857.84	0.01
1,221	603598	引力传媒	16,800	213,696.00	0.01
1,222	002110	三钢闽光	72,400	213,580.00	0.01
1,223	300412	迦南科技	73,000	210,240.00	0.01

1,224	688393	安必平	13,686	209,806.38	0.01
1,225	002228	合兴包装	88,000	205,920.00	0.01
1,226	600822	上海物贸	26,300	205,666.00	0.01
1,227	000990	诚志股份	27,600	205,344.00	0.01
1,228	600082	海泰发展	101,800	203,600.00	0.01
1,229	688105	诺唯赞	10,150	203,101.50	0.01
1,230	603102	百合股份	6,700	201,737.00	0.01
1,231	600278	东方创业	37,400	200,838.00	0.01
1,232	688580	伟思医疗	7,374	197,328.24	0.01
1,233	603897	长城科技	11,200	196,560.00	0.01
1,234	603813	原尚股份	20,600	194,464.00	0.01
1,235	301100	风光股份	14,900	193,551.00	0.01
1,236	605287	德才股份	15,200	191,368.00	0.01
1,237	688296	和达科技	19,371	188,286.12	0.00
1,238	301292	海科新源	15,200	188,024.00	0.00
1,239	600882	妙可蓝多	14,900	185,803.00	0.00
1,240	603169	兰石重装	41,100	184,950.00	0.00
1,241	605151	西上海	12,600	184,590.00	0.00
1,242	605298	必得科技	22,100	183,430.00	0.00
1,243	301228	实朴检测	19,100	178,585.00	0.00
1,244	605268	王力安防	24,700	176,111.00	0.00
1,245	600643	爱建集团	46,200	174,174.00	0.00
1,246	002397	梦洁股份	90,400	173,568.00	0.00
1,247	002529	海源复材	33,300	171,828.00	0.00
1,248	300983	尤安设计	10,900	170,912.00	0.00
1,249	603335	迪生力	41,600	170,560.00	0.00
1,250	600620	天宸股份	39,300	167,811.00	0.00
1,251	601137	博威合金	10,900	166,116.00	0.00
1,252	600980	北矿科技	12,700	165,481.00	0.00
1,253	605180	华生科技	13,900	164,715.00	0.00
1,254	605060	联德股份	11,400	163,818.00	0.00
1,255	600805	悦达投资	40,100	162,004.00	0.00
1,256	603282	亚光股份	9,600	161,856.00	0.00
1,257	300385	雪浪环境	47,800	161,086.00	0.00
1,258	300472	新元科技	36,200	160,366.00	0.00
1,259	300561	汇金科技	19,500	157,170.00	0.00
1,260	603698	航天工程	13,100	156,807.00	0.00
1,261	603909	建发合诚	18,800	156,416.00	0.00
1,262	000572	海马汽车	50,900	155,754.00	0.00
1,263	605336	帅丰电器	13,400	151,018.00	0.00
1,264	300923	研奥股份	8,600	146,200.00	0.00
1,265	002909	集泰股份	35,500	145,550.00	0.00
1,266	600681	百川能源	42,900	144,573.00	0.00

1,267	600802	福建水泥	51,800	144,004.00	0.00
1,268	600955	维远股份	9,700	139,777.00	0.00
1,269	603316	诚邦股份	38,300	138,263.00	0.00
1,270	603551	奥普科技	14,000	137,200.00	0.00
1,271	688329	艾隆科技	9,208	136,830.88	0.00
1,272	002094	青岛金王	75,000	134,250.00	0.00
1,273	002237	恒邦股份	11,600	133,516.00	0.00
1,274	603586	金麒麟	9,000	132,840.00	0.00
1,275	002426	胜利精密	83,600	132,088.00	0.00
1,276	688360	德马科技	10,863	130,790.52	0.00
1,277	603535	嘉诚国际	8,100	130,734.00	0.00
1,278	300397	天和防务	14,000	128,800.00	0.00
1,279	000803	山高环能	36,900	128,781.00	0.00
1,280	002205	国统股份	20,400	127,908.00	0.00
1,281	002620	瑞和股份	52,100	127,645.00	0.00
1,282	300651	金陵体育	10,500	127,260.00	0.00
1,283	301303	真兰仪表	11,000	126,720.00	0.00
1,284	603277	银都股份	4,200	126,168.00	0.00
1,285	002678	珠江钢琴	34,800	125,976.00	0.00
1,286	688565	力源科技	26,527	124,411.63	0.00
1,287	688161	威高骨科	6,199	122,864.18	0.00
1,288	688718	唯赛勃	14,241	121,760.55	0.00
1,289	002890	弘宇股份	14,820	118,856.40	0.00
1,290	000595	宝塔实业	34,500	116,265.00	0.00
1,291	688013	天臣医疗	7,330	108,777.20	0.00
1,292	300750	宁德时代	600	108,018.00	0.00
1,293	688663	新风光	4,523	105,250.21	0.00
1,294	600512	腾达建设	55,400	104,706.00	0.00
1,295	603188	亚邦股份	44,800	101,248.00	0.00
1,296	600746	江苏索普	17,100	100,719.00	0.00
1,297	301256	华融化学	16,400	100,696.00	0.00
1,298	688560	明冠新材	9,382	99,918.30	0.00
1,299	600990	四创电子	5,600	98,280.00	0.00
1,300	002672	东江环保	26,800	95,140.00	0.00
1,301	002377	国创高新	52,700	93,279.00	0.00
1,302	001332	锡装股份	3,900	92,898.00	0.00
1,303	301138	华研精机	3,800	90,782.00	0.00
1,304	001202	炬申股份	7,800	88,374.00	0.00
1,305	000757	浩物股份	35,100	88,101.00	0.00
1,306	688435	英方软件	3,514	87,709.44	0.00
1,307	603351	威尔药业	4,200	85,092.00	0.00
1,308	000953	河化股份	36,500	85,045.00	0.00
1,309	600927	永安期货	7,500	83,625.00	0.00

1,310	688335	复洁环保	10,259	83,610.85	0.00
1,311	600281	华阳新材	31,900	83,578.00	0.00
1,312	002691	冀凯股份	18,700	82,093.00	0.00
1,313	603365	水星家纺	5,200	81,380.00	0.00
1,314	300994	久祺股份	7,300	80,227.00	0.00
1,315	000720	新能泰山	30,500	73,505.00	0.00
1,316	300030	阳普医疗	19,600	72,912.00	0.00
1,317	603080	新疆火炬	5,400	72,684.00	0.00
1,318	002921	联诚精密	7,100	71,071.00	0.00
1,319	600148	长春一东	5,900	70,210.00	0.00
1,320	600817	宇通重工	8,500	69,700.00	0.00
1,321	600382	广东明珠	17,300	69,027.00	0.00
1,322	688670	金迪克	5,822	68,583.16	0.00
1,323	300153	科泰电源	11,400	67,830.00	0.00
1,324	003023	彩虹集团	4,200	66,990.00	0.00
1,325	688345	博力威	3,883	65,583.87	0.00
1,326	000407	胜利股份	25,100	65,511.00	0.00
1,327	002798	帝欧家居	19,900	64,874.00	0.00
1,328	300211	亿通科技	11,600	61,364.00	0.00
1,329	600202	哈空调	16,600	59,262.00	0.00
1,330	002598	山东章鼓	7,600	56,392.00	0.00
1,331	605266	健之佳	2,100	54,495.00	0.00
1,332	603729	龙韵股份	3,900	51,714.00	0.00
1,333	688030	山石网科	4,925	51,466.25	0.00
1,334	000698	沈阳化工	16,900	51,376.00	0.00
1,335	600193	创兴资源	14,400	50,400.00	0.00
1,336	600851	海欣股份	11,000	50,270.00	0.00
1,337	603100	川仪股份	2,100	49,371.00	0.00
1,338	605099	共创草坪	2,600	49,166.00	0.00
1,339	605005	合兴股份	2,900	46,284.00	0.00
1,340	300915	海融科技	1,700	44,438.00	0.00
1,341	000869	张裕 A	2,000	42,700.00	0.00
1,342	600626	申达股份	16,600	40,172.00	0.00
1,343	688225	亚信安全	3,456	39,156.48	0.00
1,344	600533	栖霞建设	19,900	39,004.00	0.00
1,345	603010	万盛股份	4,300	38,743.00	0.00
1,346	605003	众望布艺	2,400	38,520.00	0.00
1,347	600284	浦东建设	6,700	35,778.00	0.00
1,348	301037	保立佳	3,200	28,352.00	0.00
1,349	603353	和顺石油	1,900	24,624.00	0.00
1,350	603070	万控智造	2,200	24,618.00	0.00
1,351	688056	莱伯泰科	1,049	23,245.84	0.00
1,352	600857	宁波中百	3,900	22,035.00	0.00



1,353	002887	绿茵生态	2,500	16,275.00	0.00
1,354	603976	正川股份	1,000	14,110.00	0.00
1,355	605008	长鸿高科	900	11,790.00	0.00
1,356	002910	庄园牧场	1,400	8,680.00	0.00
1,357	000820	神雾节能	3,700	7,437.00	0.00
1,358	300213	佳讯飞鸿	1,200	6,840.00	0.00
1,359	001324	长青科技	100	1,620.00	0.00
1,360	000836	ST 富通	994,600	0.00	0.00
1,361	002435	ST 长康	233,200	0.00	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	601318	中国平安	166,699,756.69	1.63
2	601857	中国石油	165,971,374.00	1.63
3	300750	宁德时代	138,508,706.06	1.36
4	601288	农业银行	132,132,513.00	1.30
5	600900	长江电力	130,545,138.36	1.28
6	000333	美的集团	125,327,980.00	1.23
7	600887	伊利股份	122,146,374.00	1.20
8	600519	贵州茅台	117,283,317.57	1.15
9	601398	工商银行	115,446,168.10	1.13
10	603501	韦尔股份	109,319,384.89	1.07
11	601328	交通银行	107,856,497.00	1.06
12	300760	迈瑞医疗	107,604,271.86	1.06
13	601166	兴业银行	107,151,234.00	1.05
14	601818	光大银行	105,928,402.00	1.04
15	000651	格力电器	103,209,357.21	1.01
16	600418	江淮汽车	101,818,910.00	1.00
17	600745	闻泰科技	98,719,939.00	0.97
18	601658	邮储银行	94,904,471.00	0.93
19	600809	山西汾酒	94,889,407.12	0.93
20	601088	中国神华	93,780,390.00	0.92

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	601857	中国石油	181,817,586.00	1.78
2	601318	中国平安	164,147,472.34	1.61
3	300750	宁德时代	136,186,702.94	1.34

4	601288	农业银行	135,398,201.00	1.33
5	601398	工商银行	117,555,586.00	1.15
6	600519	贵州茅台	113,101,245.80	1.11
7	601328	交通银行	110,286,603.56	1.08
8	601319	中国人保	108,926,987.08	1.07
9	601166	兴业银行	108,223,586.42	1.06
10	300760	迈瑞医疗	105,428,148.81	1.03
11	600418	江淮汽车	103,718,015.00	1.02
12	601088	中国神华	99,133,718.45	0.97
13	000333	美的集团	98,563,933.00	0.97
14	601658	邮储银行	94,574,203.00	0.93
15	600809	山西汾酒	94,204,427.80	0.92
16	600900	长江电力	94,150,941.48	0.92
17	600887	伊利股份	90,963,852.00	0.89
18	601818	光大银行	89,848,920.00	0.88
19	601898	中煤能源	83,146,156.92	0.82
20	600745	闻泰科技	81,799,197.79	0.80

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	22,748,260,856.73
卖出股票收入（成交）总额	26,838,988,804.75

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

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	159,511,807.27	4.20
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	159,511,807.27	4.20

#### 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

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 (%)
1	019727	23 国债 24	1,417,000	144,277,581.24	3.79
2	019709	23 国债 16	150,000	15,234,226.03	0.40

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

#### 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

本基金报告期内未参与股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，根据中国建筑股份有限公司于 2023 年 07 月 25 日发布的公告，其受到晋安区城管局给予责令改正、罚款 2000 元的处罚；根据其于 2023 年 10 月 18 日发布的公告，其受到衡水市交通运输局给予责令限期改正、处 5000 元罚款的处罚；根据其于 2023 年 10 月 18 日发布的公告，其受到衡水市交通运输局给予责令立即停止作业、限期改正、处 10000 元罚款的处罚；根据其于 2024 年 01 月 26 日发布的公告，其受到晋安区城管局给予责令改正、并处罚款 2000 元的处罚；根据其于 2024 年 05 月 06 日发布的公告，其受到成都铁路监督管理局给予责令改正、处 489381.35 元罚款的行政处罚。

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。本基金投资上述主体的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 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	2,435,366.99
2	应收清算款	18,933,698.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,664,994.11
6	其他应收款	1,973.17
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,036,032.94

### 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 多因子 A	155,371	9,577.02	168,051,194.95	11.29	1,319,939,818.78	88.71
国金量化 多因子 C	41,486	16,685.22	83,141,041.19	12.01	609,061,914.42	87.99
合计	196,857	11,075.01	251,192,236.14	11.52	1,929,001,733.20	88.48

### 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	国金量化多因子 A	2,796,345.19	0.1879
	国金量化多因子 C	307,859.90	0.0445
	合计	3,104,205.09	0.1424

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
基金合同生效日（2018 年 10 月 31 日）基金份额总额	249,293,966.03	-
本报告期期初基金份额总额	2,907,275,946.13	1,967,680,520.39
本报告期基金总申购份额	496,486,649.79	458,870,895.54
减：本报告期基金总赎回份额	1,915,771,582.19	1,734,348,460.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,487,991,013.73	692,202,955.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及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，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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	
民生证券	2	4,231,177,204.06	8.53	1,886,683.66	8.53	-
长江证券	2	3,858,155,368.40	7.78	1,720,347.06	7.78	-

广发证券	2	3,754,106,877.76	7.57	1,673,972.34	7.57	-
银河证券	1	3,044,385,055.87	6.14	1,357,505.61	6.14	-
天风证券	1	2,798,719,863.00	5.64	1,247,962.87	5.64	-
平安证券	1	2,650,388,997.42	5.34	1,181,792.38	5.34	-
中信证券	2	2,635,127,070.27	5.31	1,175,018.09	5.31	-
招商证券	2	2,392,940,113.96	4.83	1,067,036.45	4.83	-
华泰证券	2	2,267,653,321.96	4.57	1,011,144.18	4.57	-
信达证券	1	2,234,061,234.16	4.51	996,147.11	4.50	-
东北证券	1	2,020,096,423.60	4.07	900,773.57	4.07	-
西南证券	1	1,975,593,818.60	3.98	880,933.80	3.98	-
中国中金财富证券	1	1,952,643,913.57	3.94	870,697.32	3.94	-
中信建投证券	2	1,863,092,736.57	3.76	830,766.87	3.76	-
山西证券	1	1,826,667,404.31	3.68	814,510.95	3.68	-
国投证券	1	1,458,609,611.02	2.94	650,396.46	2.94	-
兴业证券	1	1,240,989,243.72	2.50	553,359.70	2.50	-
东方财富证券	1	1,226,898,424.62	2.47	547,078.19	2.47	-
国金证券	2	1,224,793,574.80	2.47	546,127.21	2.47	-
国泰君安证券	2	1,093,249,616.12	2.20	487,478.80	2.20	-
华金证券	1	981,123,890.39	1.98	437,492.20	1.98	-
第一创业证券	2	883,971,173.97	1.78	394,170.01	1.78	-
恒泰证券	1	799,339,138.81	1.61	356,434.54	1.61	-
国信证券	1	765,729,678.12	1.54	341,443.82	1.54	-

首创证券	1	407,735,906 .40	0.82	181,809.63	0.82	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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华金证券、民生证券、银河证券共 3 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(%)
民生证券	-	-	273,087,000.	38.09	-	-
长江证	55,681,777	17.72	152,400,000.	21.26	-	-



券	.23		00			
广发证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	16,994,038 .14	5.41	-	-	-	-
信达证 券	-	-	179,100,000. 00	24.98	-	-
东北证 券	-	-	58,635,000.0 0	8.18	-	-
西南证 券	-	-	26,875,000.0 0	3.75	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	26,800,000.0 0	3.74	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	241,633,01 2.80	76.88	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-

国信证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 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	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 01 月 11 日
2	《国金基金管理有限公司关于本公司办公地址变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 01 月 19 日
3	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 01 月 20 日
4	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 01 月 20 日
5	《国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 02 月 06 日
6	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 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	2024 年 02 月 06 日
7	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 C 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	2024 年 02 月 06 日
8	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 03 月 29 日
9	《国金基金管理有限公司关于公司	指定披露媒体和本基金	2024 年 04 月 16 日

	系统维护的公告》	基金管理人网站	
10	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 04 月 20 日
11	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 04 月 30 日
12	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 05 月 23 日
13	《国金基金管理有限公司旗下基金调整股票估值方法的提示性公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 06 月 22 日
14	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 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	2024 年 06 月 25 日
15	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 C 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	2024 年 06 月 25 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住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

2024 年 8 月 31 日