

国金量化多因子股票型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 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

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录..... 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§ 2 基金简介..... 5

2.1 基金基本情况 5

2.2 基金产品说明 5

2.3 基金管理人和基金托管人 5

2.4 信息披露方式 6

2.5 其他相关资料 6

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6

3.2 基金净值表现 7

3.3 其他指标 10

3.4 过去三年基金的利润分配情况 10

§ 4 管理人报告..... 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12

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 14

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 16

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16

§ 5 托管人报告..... 16

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 16

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 16

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 17

§ 6 审计报告..... 17

6.1 审计报告基本信息 17

6.2 审计报告的基本内容 17

§ 7 年度财务报表..... 19

7.1 资产负债表 19

7.2 利润表 20

7.3 净资产变动表 21

7.4 报表附注 24

§ 8 投资组合报告..... 53

8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	74
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	76
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	76
§ 10 开放式基金份额变动	77
§ 11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	82
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	84
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§ 13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§ 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	1,611,553,412.03 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	1,177,839,970.30 份	433,713,441.73 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	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。 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。 本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。
业绩比较基准	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	虞志海	许俊
	联系电话	010-88005852	010-66596688
	电子邮箱	yuzhihai@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	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	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	100026	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	2022 年 10 月 14 日 (基金合同生效日)– 2022 年 12 月 31 日
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
本期已实现收益	- 877,466,013.96	- 501,029,274.81	312,050,368.06	132,875,185.27	23,364,791.51	9,324,280.03
本期利润	- 745,571,594.00	- 565,429,017.40	287,885,578.93	87,196,769.42	- 21,005,339.49	- 9,906,449.20
加权平均基金份额本期利润	-0.4565	-0.6886	0.1252	0.0572	-0.1096	-0.0580

本期加权平均净值利润率	-24.81%	-37.58%	6.10%	2.79%	-5.93%	-3.08%
本期基金份额净值增长率	-3.29%	-3.68%	13.68%	13.24%	12.23%	6.01%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	939,604,794.59	320,723,153.71	3,184,308,783.07	2,091,923,534.48	719,276,222.33	285,982,677.33
期末可供分配基金份额利润	0.7977	0.7395	1.0953	1.0631	0.8432	0.8420
期末基金资产净值	2,386,628,891.48	871,332,755.94	6,091,584,729.20	4,104,133,966.05	1,572,336,395.68	625,614,744.47
期末基金份额净值	2.0263	2.0090	2.0953	2.0858	1.8432	1.8420
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	102.63%	15.63%	109.53%	20.05%	84.32%	6.01%

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	2.56%	1.85%	0.35%	1.73%	2.21%	0.12%
过去六个月	15.96%	1.75%	14.40%	1.70%	1.56%	0.05%
过去一年	-3.29%	1.92%	6.51%	1.54%	-9.80%	0.38%
过去三年	23.37%	1.46%	-16.35%	1.19%	39.72%	0.27%
过去五年	72.54%	1.33%	13.22%	1.17%	59.32%	0.16%
自基金合同生效 起至今	102.63%	1.30%	39.08%	1.18%	63.55%	0.12%

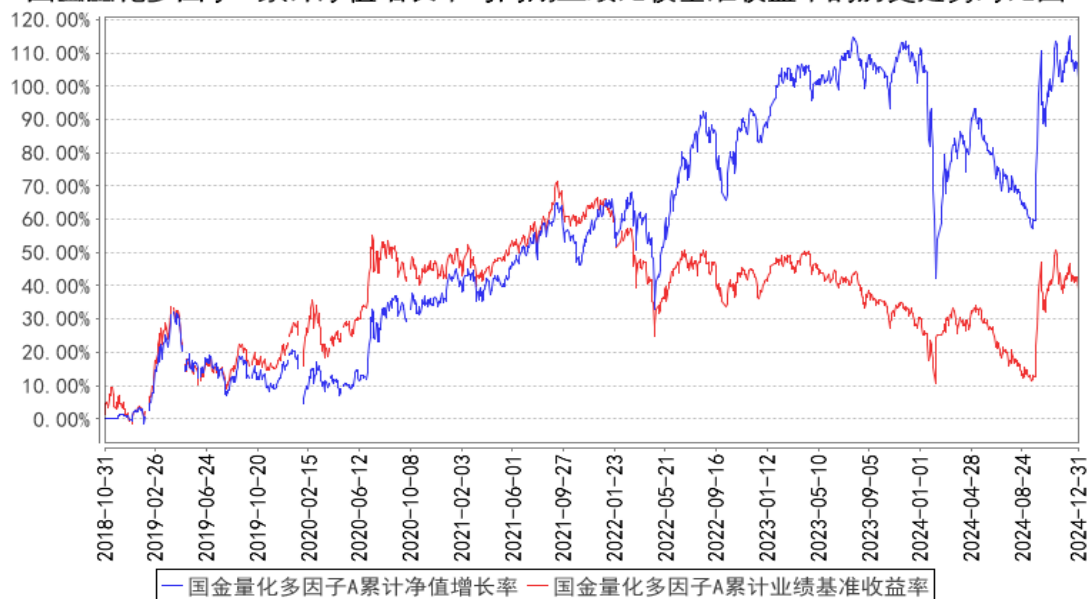
国金量化多因子 C

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
过去三个月	2.45%	1.85%	0.35%	1.73%	2.10%	0.12%
过去六个月	15.73%	1.75%	14.40%	1.70%	1.33%	0.05%
过去一年	-3.68%	1.92%	6.51%	1.54%	- 10.19%	0.38%
自基金合同生效 起至今	15.63%	1.43%	1.11%	1.17%	14.52%	0.26%

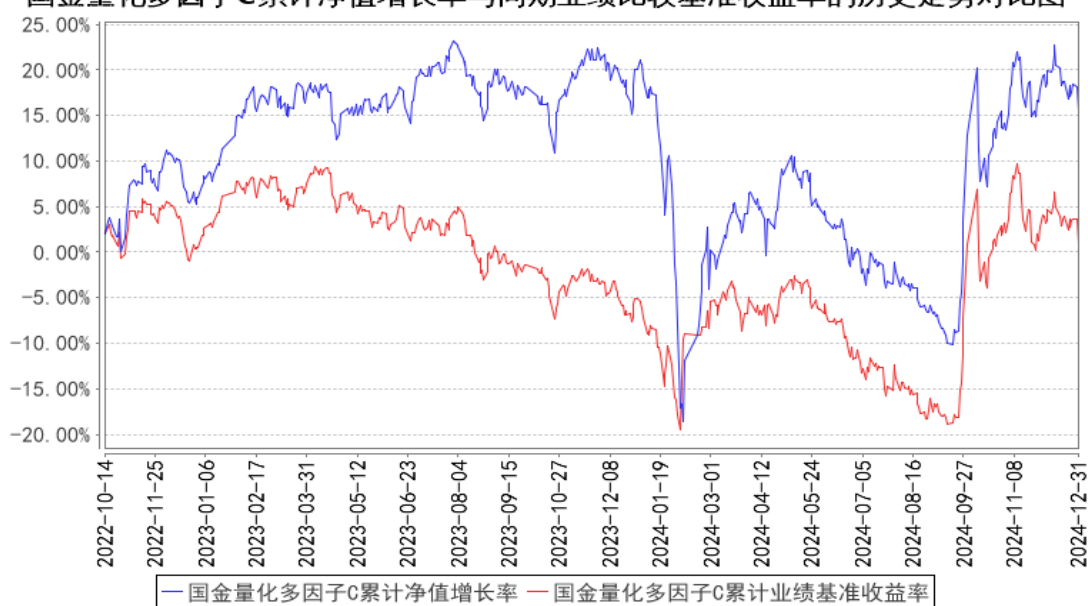
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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

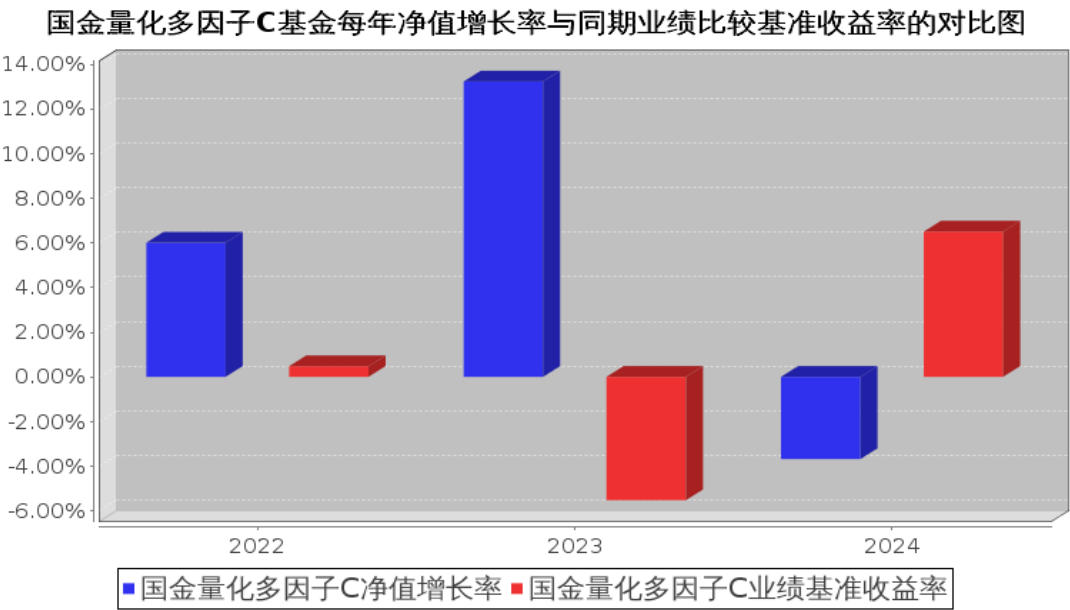
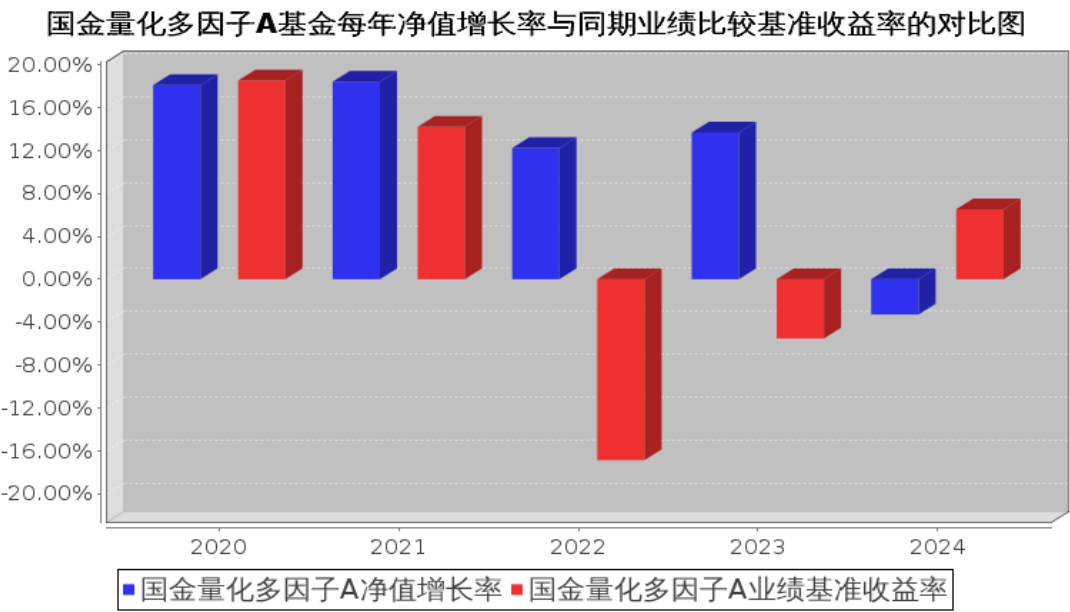


国金量化多因子C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 12 月 31 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 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金C类基金合同生效日为2022年10月14日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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12月31日，国金基金管理有限公司共管理27只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证1000指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国金中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金、国金中证A500指数增强型证券投资基金。

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

					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	3	5,321,730,449.76	2023 年 1 月 5 日
	私募资产管理计划	5	219,196,930.04	2016 年 4 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	5,540,927,379.80	-

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任专户资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合投资交易行为加强管理、监控和分析，防范不公平交易。

本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

4.3.3 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

2024 年，市场波动和活跃度均突破近十年历史极值：2 月初和 10 月上旬的市场波动高于近十年历史极值，其余大部分时段的市场波动处于市场均值或高于均值的位置；市场活跃度于 10 月初达到近十年极值，9 月下旬以来维持在历史较高水平位置。具体因子方面，贝塔值、市值和动量等因子表现较为极端，波动较大。行业涨跌方面，大部分行业（中信一级行业）在报告期内录得上涨收益，其中涨幅大于 30% 的行业为银行、非银金融和家电等；综合、医药和农林牧渔等行业跌幅较大，最大跌幅 19% 以上。

随着机构投资者参与 A 股市场的占比提升，投资理念和方法论趋于完善，各类计算机技术和模型等广泛应用，市场有效性将进一步提升。在市场趋于成熟的过程中，风险模型的成熟度亦需日趋完备，这也是国金量化模型重点迭代优化的方向。

报告期内运作结果看，本基金在风险模型迭代优化后的表现符合预期，一定程度回补了年初的回撤。国金量化策略收益来源多样化、持仓分散度较高，本基金在控制风险的基础上力争获取超越比较基准的投资回报。

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 2.0263 元，累计单位净值为 2.0263 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-3.29%，同期业绩比较基准增长率为 6.51%。

本基金 C 类份额单位净值为 2.0090 元，累计单位净值为 2.0090 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-3.68%，同期业绩比较基准增长率为 6.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

结合宏观和中观等多方面信息分析，A 股市场或将延续复杂多变、风格切换较为频繁的趋势。公募量化多头产品以获取超越业绩比较基准的投资回报为目标，通过持续优化风险模型，一定程度上有利于产品提升相对优势。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层以及董事会。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

（1）进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况及时制定相关管理制度，细化管理流程，并持续更新和完善，本基金管理人制定的规章制度涵盖公司主要业务范围。

（2）强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

（3）有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，不断提高业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2025)审字第 70015670_A14 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金量化多因子股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化多因子股票型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金量化多因子股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	国金量化多因子股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大

	错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化多因子股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国金量化多因子股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金量化多因子股票型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册会计师的姓名	宋雪强	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	200,028,445.58	533,589,354.26
结算备付金		17,820,121.14	46,815,213.75
存出保证金		1,048,245.49	4,881,490.85
交易性金融资产	7.4.7.2	2,900,625,370.54	9,647,785,304.10
其中：股票投资		2,900,625,370.54	9,366,157,331.49
基金投资		-	-
债券投资		-	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	172,837,240.57	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		8,794,623.31	84,048,991.73
应收股利		-	-
应收申购款		2,840,202.39	12,136,926.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	1,973.17	-
资产总计		3,303,996,222.19	10,329,257,281.53
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,148,987.80	-
应付赎回款		18,615,597.63	110,173,605.05
应付管理人报酬		3,515,497.79	10,882,329.02
应付托管费		585,916.32	1,813,721.47
应付销售服务费		325,335.80	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	7.4.7.9	18,843,239.43	9,147,402.14
负债合计		46,034,574.77	133,538,586.28
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,611,553,412.03	4,874,956,466.52
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,646,408,235.39	5,320,762,228.73
净资产合计		3,257,961,647.42	10,195,718,695.25
负债和净资产总计		3,303,996,222.19	10,329,257,281.53

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，国金量化多因子 A 基金份额净值 2.0263 元，基金份额总额 1,177,839,970.30 份；国金量化多因子 C 基金份额净值 2.0090 元，基金份额总额 433,713,441.73 份。国金量化多因子份额总额合计为 1,611,553,412.03 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,241,719,897.07	505,524,128.97
1. 利息收入		1,595,061.30	8,247,622.49
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,265,413.39	3,193,684.48
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		329,647.91	5,053,938.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		-1,317,391,526.80	552,921,138.38
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,390,715,213.16	476,244,548.05

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	3,830,689.16	576,369.77
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	69,492,997.20	76,100,220.56
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）	7.4.7.20	67,494,677.37	-69,843,204.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	6,581,891.06	14,198,573.08
减：二、营业总支出		69,280,714.33	130,441,780.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	54,009,111.71	102,308,715.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,001,518.66	15,506,925.59
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,007,859.02	12,339,546.74
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	262,224.94	286,592.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,311,000,611.40	375,082,348.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,311,000,611.40	375,082,348.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,311,000,611.40	375,082,348.35

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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)	-3,263,403,054.49	-	-3,674,353,993.34	-6,937,757,047.83
(一)、综合收益总额	-	-	-1,311,000,611.40	-1,311,000,611.40
(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)	-3,263,403,054.49	-	-2,363,353,381.94	-5,626,756,436.43
其中：1. 基金申购款	1,567,807,177.76	-	1,389,355,874.04	2,957,163,051.80
2. 基金赎回款	-4,831,210,232.25	-	-3,752,709,255.98	-8,583,919,488.23
(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	1,611,553,412.03	-	1,646,408,235.39	3,257,961,647.42
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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)	3,682,264,226.03	-	4,315,503,329.07	7,997,767,555.10
(一)、综合收益总额	-	-	375,082,348.35	375,082,348.35
(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)	3,682,264,226.03	-	3,940,420,980.72	7,622,685,206.75
其中：1. 基金申购款	7,619,408,025.42	-	8,060,988,224.66	15,680,396,250.08
2. 基金赎回款	- 3,937,143,799.39	-	- 4,120,567,243.94	- 8,057,711,043.33
(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	4,874,956,466.52	-	5,320,762,228.73	10,195,718,695.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金量化多因子股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[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，本基金首次设立募集规模为 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： $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以

摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金
额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余
额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相
关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除
适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以
公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或
损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流
入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计
入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直
线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种。
若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交
易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期
末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部
分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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征增值税试点的通知》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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	200,028,445.58	533,589,354.26
等于：本金	200,005,465.29	533,530,615.46
加：应计利息	22,980.29	58,738.80
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	200,028,445.58	533,589,354.26

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,966,523,339.38	-	2,900,625,370.54	-65,897,968.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,966,523,339.38	-	2,900,625,370.54	-65,897,968.84
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,500,289,335.70	-	9,366,157,331.49	-134,132,004.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	279,246,642.00	1,641,972.61	281,627,972.61	739,358.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	279,246,642.00	1,641,972.61	281,627,972.61	739,358.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,779,535,977.70	1,641,972.61	9,647,785,304.10	-133,392,646.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	172,837,240.57	-
银行间市场	-	-
合计	172,837,240.57	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	1,973.17	-
待摊费用	-	-
合计	1,973.17	-

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,767.93	20,076.66
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	18,750,471.50	8,907,325.48
其中：交易所市场	18,750,471.50	8,907,325.48
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	90,000.00	220,000.00
合计	18,843,239.43	9,147,402.14

7.4.7.10 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 12 月 31 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	894,184,029.44	894,184,029.44
本期赎回（以“-”号填列）	-2,623,620,005.27	-2,623,620,005.27
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	1,177,839,970.30	1,177,839,970.30

国金量化多因子 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	673,623,148.32	673,623,148.32
本期赎回（以“-”号填列）	-2,207,590,226.98	-2,207,590,226.98
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	433,713,441.73	433,713,441.73

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。

7.4.7.11 其他综合收益

无

7.4.7.12 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	-877,466,013.96	131,894,419.96	-745,571,594.00
本期基金份额交易产生的变动数	-1,424,736,496.74	194,788,228.85	-1,229,948,267.89
其中：基金申购款	702,380,773.79	113,980,866.50	816,361,640.29
基金赎回款	-2,127,117,270.53	80,807,362.35	-2,046,309,908.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	939,604,794.59	269,184,126.59	1,208,788,921.18

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	-501,029,274.81	-64,399,742.59	-565,429,017.40
本期基金份额交易产生的变动数	-1,270,171,105.96	136,765,991.91	-1,133,405,114.05
其中：基金申购款	473,410,640.17	99,583,593.58	572,994,233.75
基金赎回款	-1,743,581,746.13	37,182,398.33	-1,706,399,347.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	320,723,153.71	116,896,160.50	437,619,314.21

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	771,841.92	2,237,335.44
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	433,011.19	898,266.43
其他	60,560.28	58,082.61
合计	1,265,413.39	3,193,684.48

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,390,715,213.16	476,244,548.05
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	-1,390,715,213.16	476,244,548.05

7.4.7.14.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	45,287,511,871.86	42,991,302,810.08
减：卖出股票成本总额	46,612,044,051.38	42,434,290,550.60
减：交易费用	66,183,033.64	80,767,711.43
买卖股票差价收入	-1,390,715,213.16	476,244,548.05

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	3,106,203.16	576,369.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	724,486.00	-
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	3,830,689.16	576,369.77

7.4.7.15.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	379,617,365.97	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	373,435,422.00	-
减：应计利息总额	5,457,457.97	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	724,486.00	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	69,492,997.20	76,100,220.56
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	69,492,997.20	76,100,220.56

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
------	--	---

1. 交易性金融资产	67,494,677.37	-69,843,204.98
股票投资	68,234,035.37	-70,582,562.98
债券投资	-739,358.00	739,358.00
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	67,494,677.37	-69,843,204.98

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	5,998,285.69	13,793,428.72
基金转换费收入	583,605.37	405,144.36
合计	6,581,891.06	14,198,573.08

7.4.7.22 信用减值损失

无

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	52,224.94	66,592.49
合计	262,224.94	286,592.49

7.4.7.24 分部报告

无

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	1.43	490,425,729.72	0.53

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

无

7.4.10.1.4 权证交易

无

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国金证券股份有 限公司	546,127.21	1.43	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国金证券股份有 限公司	218,681.06	0.54	218,681.06	2.46

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	54,009,111.71	102,308,715.80
其中：应支付销售机构的客户维 护费	18,982,861.94	28,124,983.23
应支付基金管理人的净管理费	35,026,249.77	74,183,732.57

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。

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,001,518.66	15,506,925.59

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	-	1,103,722.96	1,103,722.96
国金证券股份有限公司	-	351,550.84	351,550.84
合计	-	1,455,273.80	1,455,273.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	4,605,235.17	4,605,235.17
国金证券股份有限公司	-	477,846.54	477,846.54
合计	-	5,083,081.71	5,083,081.71

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无

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

无

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	200,028,445.58	771,841.92	533,589,354.26	2,237,335.44

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	200,028,445.58	-	-	-	-	-	200,028,445.58
结算备付金	17,820,121.14	-	-	-	-	-	17,820,121.14
存出保证金	1,048,245.49	-	-	-	-	-	1,048,245.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,900,625,370.54	2,900,625,370.54
买入返售金融资产	172,837,240.57	-	-	-	-	-	172,837,240.57
应收清算款	-	-	-	-	-	8,794,623.31	8,794,623.31
应收申购款	-	-	-	-	-	2,840,202.39	2,840,202.39
其他资产	-	-	-	-	-	1,973.17	1,973.17
资产总计	391,734,052.78	-	-	-	-	2,912,262,169.41	3,303,996,222.19
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	4,148,987.80	4,148,987.80

应付赎回款	-	-	-	-	-	18,615,597.63	18,615,597.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,515,497.79	3,515,497.79
应付托管费	-	-	-	-	-	585,916.32	585,916.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	325,335.80	325,335.80
其他负债	-	-	-	-	-	18,843,239.43	18,843,239.43
负债总计	-	-	-	-	-	46,034,574.77	46,034,574.77
利率敏感度缺口	391,734,052.78	-	-	-	-	-2,866,227,594.64	3,257,961,647.42
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有交易性债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	2,900,625,370.54	89.03	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	—	—	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	2,900,625,370.54	89.03	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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数（000905.SH）变化 5%，其他变量不变；
----	-------------------------------------

	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	+5%	132,647,957.69	433,359,625.94
	-5%	-132,647,957.69	-433,359,625.94

7.4.13.4.4 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	2,900,625,370.54	9,355,119,954.06
第二层次	-	292,659,267.90
第三层次	-	6,082.14
合计	2,900,625,370.54	9,647,785,304.10

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	6,082.14	6,082.14
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,082.14	6,082.14
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	8,866.03	8,866.03
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-2,783.89	-2,783.89
其中：计入损益的利得或损失	-	-2,783.89	-2,783.89
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	6,082.14	6,082.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-2,783.89	-2,783.89

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	6,082.14	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2053	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。
--

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2025 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
----	----	----	-----------

			(%)
1	权益投资	2,900,625,370.54	87.79
	其中：股票	2,900,625,370.54	87.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	172,837,240.57	5.23
	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	217,848,566.72	6.59
8	其他各项资产	12,685,044.36	0.38
9	合计	3,303,996,222.19	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	23,378,937.00	0.72
B	采矿业	43,884,895.76	1.35
C	制造业	1,786,731,010.11	54.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	129,207,380.80	3.97
E	建筑业	155,791,768.42	4.78
F	批发和零售业	56,093,597.60	1.72
G	交通运输、仓储和邮政业	192,198,710.88	5.90
H	住宿和餐饮业	4,659,777.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,973,507.47	3.93
J	金融业	259,234,469.34	7.96
K	房地产业	3,871,682.00	0.12
L	租赁和商务服务业	14,436,551.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	27,320,707.61	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	55,955,513.15	1.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,804,415.40	0.21
R	文化、体育和娱乐业	13,082,447.00	0.40
S	综合	-	-

	合计	2,900,625,370.54	89.03
--	----	------------------	-------

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600919	江苏银行	4,796,100	47,097,702.00	1.45
2	000651	格力电器	1,018,500	46,290,825.00	1.42
3	600887	伊利股份	1,491,992	45,028,318.56	1.38
4	600559	老白干酒	1,643,700	34,501,263.00	1.06
5	300567	精测电子	530,415	34,105,684.50	1.05
6	601669	中国电建	6,174,277	33,711,552.42	1.03
7	300672	国科微	478,700	31,953,225.00	0.98
8	605358	立昂微	1,207,700	29,914,729.00	0.92
9	000513	丽珠集团	784,669	29,817,422.00	0.92
10	600820	隧道股份	4,029,600	28,972,824.00	0.89
11	600004	白云机场	2,688,900	25,813,440.00	0.79
12	601686	友发集团	4,597,420	25,101,913.20	0.77
13	600519	贵州茅台	16,200	24,688,800.00	0.76
14	603087	甘李药业	536,500	23,659,650.00	0.73
15	688122	西部超导	548,406	23,482,744.92	0.72
16	601868	中国能建	10,196,400	23,349,756.00	0.72
17	601111	中国国航	2,946,400	23,306,024.00	0.72
18	688425	铁建重工	4,835,533	21,276,345.20	0.65
19	601006	大秦铁路	3,060,000	20,746,800.00	0.64
20	600008	首创环保	6,272,700	20,574,456.00	0.63
21	600132	重庆啤酒	314,800	19,838,696.00	0.61
22	601615	明阳智能	1,540,900	19,430,749.00	0.60
23	688012	中微公司	101,462	19,192,551.92	0.59
24	600380	健康元	1,599,700	18,028,619.00	0.55
25	600570	恒生电子	626,000	17,521,740.00	0.54
26	600926	杭州银行	1,154,900	16,873,089.00	0.52
27	002409	雅克科技	286,100	16,579,495.00	0.51
28	002439	启明星辰	1,046,400	16,554,048.00	0.51
29	002015	协鑫能科	2,070,300	16,065,528.00	0.49
30	688387	信科移动	2,671,576	15,922,592.96	0.49
31	601990	南京证券	1,836,966	15,908,125.56	0.49
32	601877	正泰电器	679,500	15,907,095.00	0.49
33	601666	平煤股份	1,570,972	15,741,139.44	0.48
34	601975	招商南油	4,989,400	15,616,822.00	0.48
35	601636	旗滨集团	2,774,670	15,565,898.70	0.48

36	600143	金发科技	1,796,100	15,518,304.00	0.48
37	000591	太阳能	3,128,760	14,892,897.60	0.46
38	600115	中国东航	3,595,100	14,380,400.00	0.44
39	601128	常熟银行	1,867,580	14,137,580.60	0.43
40	300285	国瓷材料	828,600	14,119,344.00	0.43
41	603799	华友钴业	477,216	13,963,340.16	0.43
42	600906	财达证券	1,937,000	13,752,700.00	0.42
43	002138	顺络电子	417,900	13,155,492.00	0.40
44	601997	贵阳银行	2,156,700	12,940,200.00	0.40
45	600699	均胜电子	820,500	12,857,235.00	0.39
46	002465	海格通信	1,164,400	12,785,112.00	0.39
47	600409	三友化工	2,332,700	12,596,580.00	0.39
48	000060	中金岭南	2,684,744	12,591,449.36	0.39
49	600598	北大荒	841,800	12,416,550.00	0.38
50	601016	节能风电	3,886,900	12,321,473.00	0.38
51	000089	深圳机场	1,778,200	12,251,798.00	0.38
52	600456	宝钛股份	430,200	12,239,190.00	0.38
53	600600	青岛啤酒	148,000	11,976,160.00	0.37
54	600535	天士力	804,600	11,634,516.00	0.36
55	002385	大北农	2,663,200	11,531,656.00	0.35
56	601717	郑煤机	876,100	11,371,778.00	0.35
57	601117	中国化学	1,366,500	11,328,285.00	0.35
58	002120	韵达股份	1,505,500	11,321,360.00	0.35
59	600170	上海建工	4,257,700	11,282,905.00	0.35
60	603012	创力集团	2,114,000	11,225,340.00	0.34
61	600033	福建高速	2,812,450	10,912,306.00	0.33
62	000728	国元证券	1,294,000	10,817,840.00	0.33
63	000825	太钢不锈	3,098,900	10,784,172.00	0.33
64	603650	彤程新材	307,200	10,742,784.00	0.33
65	601077	渝农商行	1,771,000	10,714,550.00	0.33
66	600566	济川药业	365,700	10,634,556.00	0.33
67	600688	上海石化	3,491,400	10,544,028.00	0.32
68	002460	赣锋锂业	300,100	10,506,501.00	0.32
69	600305	恒顺醋业	1,314,800	10,492,104.00	0.32
70	688819	天能股份	382,831	10,420,659.82	0.32
71	002928	华夏航空	1,338,000	10,382,880.00	0.32
72	600096	云天化	464,800	10,365,040.00	0.32
73	600497	驰宏锌锗	1,858,410	10,351,343.70	0.32
74	002061	浙江交科	2,463,800	10,052,304.00	0.31
75	002250	联化科技	1,820,600	10,031,506.00	0.31
76	002948	青岛银行	2,534,700	9,834,636.00	0.30
77	601568	北元集团	2,332,170	9,795,114.00	0.30
78	000990	诚志股份	1,247,800	9,670,450.00	0.30

79	600261	阳光照明	2,902,500	9,491,175.00	0.29
80	600141	兴发集团	434,600	9,430,820.00	0.29
81	000902	新洋丰	722,200	9,417,488.00	0.29
82	300012	华测检测	721,627	8,969,823.61	0.28
83	601609	金田股份	1,509,000	8,903,100.00	0.27
84	600195	中牧股份	1,314,400	8,819,624.00	0.27
85	600582	天地科技	1,418,700	8,767,566.00	0.27
86	603588	高能环境	1,638,316	8,584,775.84	0.26
87	600977	中国电影	736,800	8,554,248.00	0.26
88	600369	西南证券	1,798,700	8,399,929.00	0.26
89	000898	鞍钢股份	3,497,100	8,393,040.00	0.26
90	603589	口子窖	211,000	8,279,640.00	0.25
91	603027	千禾味业	678,660	8,218,572.60	0.25
92	600155	华创云信	1,105,600	8,181,440.00	0.25
93	600330	天通股份	1,150,800	8,170,680.00	0.25
94	002396	星网锐捷	424,700	8,065,053.00	0.25
95	001227	兰州银行	3,274,518	8,055,314.28	0.25
96	002376	新北洋	1,232,300	8,034,596.00	0.25
97	600037	歌华有线	1,076,400	8,029,944.00	0.25
98	001218	丽臣实业	464,740	8,007,470.20	0.25
99	603113	金能科技	1,418,800	7,987,844.00	0.25
100	600063	皖维高新	1,968,400	7,873,600.00	0.24
101	601377	兴业证券	1,254,100	7,850,666.00	0.24
102	600623	华谊集团	1,120,302	7,842,114.00	0.24
103	603658	安图生物	178,800	7,802,832.00	0.24
104	002807	江阴银行	1,782,240	7,752,744.00	0.24
105	002174	游族网络	828,500	7,746,475.00	0.24
106	600528	中铁工业	959,300	7,731,958.00	0.24
107	600391	航发科技	387,400	7,689,890.00	0.24
108	000539	粤电力 A	1,695,700	7,681,521.00	0.24
109	600422	昆药集团	482,900	7,653,965.00	0.23
110	002191	劲嘉股份	1,822,293	7,653,630.60	0.23
111	688057	金达莱	687,637	7,632,770.70	0.23
112	600496	精工钢构	2,522,500	7,617,950.00	0.23
113	688508	芯朋微	172,633	7,418,040.01	0.23
114	000937	冀中能源	1,173,301	7,415,262.32	0.23
115	600863	内蒙华电	1,686,500	7,302,545.00	0.22
116	301015	百洋医药	299,800	7,258,158.00	0.22
117	600596	新安股份	825,500	7,247,890.00	0.22
118	603299	苏盐井神	640,900	7,139,626.00	0.22
119	000650	仁和药业	1,182,700	6,812,352.00	0.21
120	300482	万孚生物	300,800	6,740,928.00	0.21
121	002773	康弘药业	343,400	6,730,640.00	0.21

122	605166	聚合顺	559,900	6,702,003.00	0.21
123	000967	盈峰环境	1,346,200	6,690,614.00	0.21
124	600717	天津港	1,369,004	6,667,049.48	0.20
125	601678	滨化股份	1,772,100	6,663,096.00	0.20
126	000778	新兴铸管	1,720,600	6,607,104.00	0.20
127	000750	国海证券	1,534,700	6,568,516.00	0.20
128	605589	圣泉集团	273,500	6,449,130.00	0.20
129	002539	云图控股	823,500	6,439,770.00	0.20
130	600477	杭萧钢构	2,502,122	6,430,453.54	0.20
131	300682	朗新集团	524,100	6,394,020.00	0.20
132	300601	康泰生物	372,060	6,380,829.00	0.20
133	002745	木林森	723,686	6,310,541.92	0.19
134	688098	申联生物	1,150,657	6,294,093.79	0.19
135	000408	藏格矿业	224,900	6,236,477.00	0.19
136	002507	涪陵榨菜	438,460	6,195,439.80	0.19
137	601718	际华集团	2,180,500	6,192,620.00	0.19
138	002202	金风科技	596,070	6,157,403.10	0.19
139	002204	大连重工	1,235,800	6,154,284.00	0.19
140	601012	隆基绿能	387,740	6,091,395.40	0.19
141	600737	中粮糖业	596,100	6,086,181.00	0.19
142	600390	五矿资本	930,100	5,999,145.00	0.18
143	600459	贵研铂业	435,199	5,975,282.27	0.18
144	600643	爱建集团	1,141,200	5,900,004.00	0.18
145	600867	通化东宝	703,800	5,672,628.00	0.17
146	002218	拓日新能	1,420,400	5,638,988.00	0.17
147	000709	河钢股份	2,543,300	5,620,693.00	0.17
148	002544	普天科技	259,400	5,558,942.00	0.17
149	600967	内蒙一机	651,100	5,534,350.00	0.17
150	603989	艾华集团	365,100	5,505,708.00	0.17
151	600073	光明肉业	784,300	5,443,042.00	0.17
152	600348	华阳股份	730,300	5,177,827.00	0.16
153	300048	合康新能	1,016,300	5,122,152.00	0.16
154	688159	有方科技	164,233	4,966,405.92	0.15
155	600655	豫园股份	769,400	4,947,242.00	0.15
156	601375	中原证券	1,143,400	4,939,488.00	0.15
157	688367	工大高科	321,398	4,936,673.28	0.15
158	603936	博敏电子	585,600	4,930,752.00	0.15
159	600351	亚宝药业	806,000	4,908,540.00	0.15
160	603323	苏农银行	926,000	4,898,540.00	0.15
161	600284	浦东建设	768,000	4,815,360.00	0.15
162	000783	长江证券	706,000	4,814,920.00	0.15
163	601886	江河集团	888,200	4,796,280.00	0.15
164	002145	中核钛白	1,125,500	4,772,120.00	0.15

165	300596	利安隆	156,300	4,767,150.00	0.15
166	603700	宁水集团	469,200	4,696,692.00	0.14
167	600882	妙可蓝多	262,200	4,693,380.00	0.14
168	600549	厦门钨业	243,300	4,688,391.00	0.14
169	600873	梅花生物	465,800	4,671,974.00	0.14
170	603456	九洲药业	336,200	4,599,216.00	0.14
171	300212	易华录	196,100	4,588,740.00	0.14
172	000837	秦川机床	509,800	4,572,906.00	0.14
173	603966	法兰泰克	591,900	4,569,468.00	0.14
174	601015	陕西黑猫	1,359,200	4,539,728.00	0.14
175	000498	山东路桥	761,400	4,530,330.00	0.14
176	603899	晨光股份	148,500	4,492,125.00	0.14
177	600098	广州发展	693,800	4,454,196.00	0.14
178	688005	容百科技	141,059	4,450,411.45	0.14
179	002135	东南网架	1,042,800	4,431,900.00	0.14
180	603898	好莱客	466,400	4,384,160.00	0.13
181	300190	维尔利	1,248,900	4,383,639.00	0.13
182	688078	龙软科技	165,192	4,329,682.32	0.13
183	300849	锦盛新材	307,100	4,314,755.00	0.13
184	002410	广联达	366,900	4,314,744.00	0.13
185	601311	骆驼股份	519,900	4,309,971.00	0.13
186	000905	厦门港务	598,800	4,287,408.00	0.13
187	002958	青农商行	1,402,900	4,264,816.00	0.13
188	601139	深圳燃气	604,000	4,264,240.00	0.13
189	600259	广晟有色	152,200	4,232,682.00	0.13
190	600392	盛和资源	411,091	4,226,015.48	0.13
191	002258	利尔化学	506,974	4,192,674.98	0.13
192	601212	白银有色	1,505,100	4,184,178.00	0.13
193	603013	亚普股份	279,000	4,179,420.00	0.13
194	601965	中国汽研	234,500	4,131,890.00	0.13
195	600713	南京医药	831,900	4,126,224.00	0.13
196	601611	中国核建	452,800	4,093,312.00	0.13
197	002454	松芝股份	606,200	4,031,230.00	0.12
198	600495	晋西车轴	1,058,500	4,022,300.00	0.12
199	600971	恒源煤电	424,900	3,998,309.00	0.12
200	002386	天原股份	872,600	3,987,782.00	0.12
201	600054	黄山旅游	344,500	3,892,850.00	0.12
202	002033	丽江股份	434,100	3,850,467.00	0.12
203	002326	永太科技	430,336	3,847,203.84	0.12
204	600035	楚天高速	834,100	3,836,860.00	0.12
205	601888	中国中免	57,100	3,826,271.00	0.12
206	688519	南亚新材	179,031	3,806,199.06	0.12
207	002151	北斗星通	142,000	3,768,680.00	0.12

208	688199	久日新材	247,550	3,725,627.50	0.11
209	300850	新强联	193,400	3,695,874.00	0.11
210	002788	鹭燕医药	449,100	3,687,111.00	0.11
211	300259	新天科技	1,046,254	3,661,889.00	0.11
212	601187	厦门银行	647,900	3,654,156.00	0.11
213	603368	柳药集团	204,000	3,643,440.00	0.11
214	601518	吉林高速	1,309,100	3,639,298.00	0.11
215	300821	东岳硅材	466,600	3,620,816.00	0.11
216	002081	金螳螂	1,008,000	3,598,560.00	0.11
217	002448	中原内配	572,500	3,583,850.00	0.11
218	600516	方大炭素	738,600	3,567,438.00	0.11
219	001213	中铁特货	848,500	3,538,245.00	0.11
220	002266	浙富控股	1,130,700	3,527,784.00	0.11
221	600361	创新新材	897,300	3,463,578.00	0.11
222	000541	佛山照明	554,600	3,438,520.00	0.11
223	001236	弘业期货	354,500	3,417,380.00	0.10
224	600941	中国移动	28,900	3,414,824.00	0.10
225	688579	山大地纬	370,120	3,401,402.80	0.10
226	002479	富春环保	711,800	3,373,932.00	0.10
227	002960	青鸟消防	288,470	3,366,444.90	0.10
228	000030	富奥股份	653,200	3,350,916.00	0.10
229	600062	华润双鹤	166,700	3,300,660.00	0.10
230	600108	亚盛集团	1,125,700	3,298,301.00	0.10
231	605259	绿田机械	215,860	3,270,279.00	0.10
232	002726	龙大美食	412,700	3,268,584.00	0.10
233	600258	首旅酒店	222,400	3,262,608.00	0.10
234	300789	唐源电气	218,300	3,261,402.00	0.10
235	603385	惠达卫浴	510,800	3,248,688.00	0.10
236	600075	新疆天业	741,373	3,224,972.55	0.10
237	600959	江苏有线	961,600	3,221,360.00	0.10
238	603858	步长制药	203,800	3,220,040.00	0.10
239	600502	安徽建工	673,100	3,217,418.00	0.10
240	002446	盛路通信	491,100	3,216,705.00	0.10
241	300244	迪安诊断	283,100	3,213,185.00	0.10
242	603041	美思德	297,743	3,182,872.67	0.10
243	688133	泰坦科技	173,838	3,170,805.12	0.10
244	002007	华兰生物	188,000	3,167,800.00	0.10
245	002746	仙坛股份	497,800	3,156,052.00	0.10
246	600810	神马股份	387,973	3,138,701.57	0.10
247	603938	三孚股份	289,940	3,134,251.40	0.10
248	002391	长青股份	624,050	3,126,490.50	0.10
249	688080	映翰通	94,951	3,125,786.92	0.10
250	600521	华海药业	174,500	3,118,315.00	0.10

251	603817	海峡环保	549,700	3,067,326.00	0.09
252	002367	康力电梯	445,200	3,058,524.00	0.09
253	600998	九州通	597,200	3,057,664.00	0.09
254	300869	康泰医学	218,200	3,041,708.00	0.09
255	002768	国恩股份	131,800	3,040,626.00	0.09
256	000601	韶能股份	745,800	3,027,948.00	0.09
257	600433	冠豪高新	954,700	3,026,399.00	0.09
258	000407	胜利股份	879,300	3,007,206.00	0.09
259	002758	浙农股份	342,400	2,996,000.00	0.09
260	000789	万年青	597,940	2,995,679.40	0.09
261	600058	五矿发展	419,600	2,987,552.00	0.09
262	603727	博迈科	259,500	2,979,060.00	0.09
263	688239	航宇科技	79,692	2,972,511.60	0.09
264	000411	英特集团	278,800	2,969,220.00	0.09
265	000507	珠海港	578,800	2,951,880.00	0.09
266	600499	科达制造	374,800	2,923,440.00	0.09
267	300158	振东制药	675,000	2,916,000.00	0.09
268	600512	腾达建设	1,208,000	2,862,960.00	0.09
269	603927	中科软	131,300	2,849,210.00	0.09
270	002961	瑞达期货	196,700	2,826,579.00	0.09
271	603367	辰欣药业	205,700	2,826,318.00	0.09
272	300702	天宇股份	168,700	2,810,542.00	0.09
273	000019	深粮控股	421,100	2,766,627.00	0.08
274	600507	方大特钢	683,000	2,766,150.00	0.08
275	603115	海星股份	212,900	2,748,539.00	0.08
276	002540	亚太科技	445,900	2,746,744.00	0.08
277	002772	众兴菌业	371,800	2,740,166.00	0.08
278	600526	菲达环保	608,000	2,729,920.00	0.08
279	002498	汉缆股份	803,200	2,722,848.00	0.08
280	002206	海利得	631,200	2,707,848.00	0.08
281	603995	甬金股份	148,000	2,706,920.00	0.08
282	300857	协创数据	25,300	2,704,317.00	0.08
283	300363	博腾股份	171,000	2,696,670.00	0.08
284	002328	新朋股份	435,300	2,668,389.00	0.08
285	002483	润邦股份	511,400	2,664,394.00	0.08
286	603987	康德莱	368,800	2,647,984.00	0.08
287	600498	烽火通信	135,900	2,644,614.00	0.08
288	600017	日照港	824,400	2,638,080.00	0.08
289	601956	东贝集团	545,300	2,633,799.00	0.08
290	000629	钒钛股份	911,700	2,625,696.00	0.08
291	600705	中航产融	718,300	2,607,429.00	0.08
292	300957	贝泰妮	60,900	2,599,821.00	0.08
293	300161	华中数控	98,700	2,599,758.00	0.08

294	000900	现代投资	589,100	2,597,931.00	0.08
295	300253	卫宁健康	360,500	2,581,180.00	0.08
296	000751	锌业股份	912,400	2,563,844.00	0.08
297	600095	湘财股份	353,700	2,546,640.00	0.08
298	601101	昊华能源	308,500	2,538,955.00	0.08
299	600732	爱旭股份	230,000	2,534,600.00	0.08
300	002636	金安国纪	325,900	2,522,466.00	0.08
301	600908	无锡银行	426,700	2,521,797.00	0.08
302	300451	创业慧康	562,600	2,520,448.00	0.08
303	600897	厦门空港	164,780	2,509,599.40	0.08
304	601866	中远海发	952,000	2,484,720.00	0.08
305	601528	瑞丰银行	438,430	2,468,360.90	0.08
306	600029	南方航空	379,400	2,462,306.00	0.08
307	600918	中泰证券	374,100	2,457,837.00	0.08
308	002972	科安达	232,500	2,418,000.00	0.07
309	600379	宝光股份	254,800	2,412,956.00	0.07
310	600329	达仁堂	78,200	2,408,560.00	0.07
311	000726	鲁 泰 A	368,900	2,405,228.00	0.07
312	000686	东北证券	302,200	2,399,468.00	0.07
313	000035	中国天楹	489,600	2,384,352.00	0.07
314	002342	巨力索具	737,000	2,380,510.00	0.07
315	002627	三峡旅游	472,900	2,373,958.00	0.07
316	600755	厦门国贸	357,500	2,373,800.00	0.07
317	603681	永冠新材	183,900	2,370,471.00	0.07
318	600618	氯碱化工	239,200	2,358,512.00	0.07
319	300258	精锻科技	264,600	2,357,586.00	0.07
320	601008	连云港	613,300	2,348,939.00	0.07
321	300194	福安药业	524,900	2,341,054.00	0.07
322	603105	芯能科技	259,600	2,338,996.00	0.07
323	002573	清新环境	586,900	2,335,862.00	0.07
324	601098	中南传媒	154,900	2,325,049.00	0.07
325	002382	蓝帆医疗	450,699	2,312,085.87	0.07
326	002560	通达股份	335,800	2,290,156.00	0.07
327	300593	新雷能	204,100	2,285,920.00	0.07
328	300110	华仁药业	641,800	2,259,136.00	0.07
329	300737	科顺股份	436,700	2,214,069.00	0.07
330	601811	新华文轩	139,000	2,203,150.00	0.07
331	603167	渤海轮渡	249,200	2,202,928.00	0.07
332	300447	全信股份	154,600	2,190,682.00	0.07
333	603886	元祖股份	150,800	2,174,536.00	0.07
334	300741	华宝股份	124,200	2,159,838.00	0.07
335	603836	海程邦达	176,800	2,149,888.00	0.07
336	002375	亚厦股份	556,000	2,146,160.00	0.07

337	002969	嘉美包装	689,100	2,143,101.00	0.07
338	600637	东方明珠	275,922	2,141,154.72	0.07
339	300435	中泰股份	176,400	2,130,912.00	0.07
340	601368	绿城水务	443,700	2,112,012.00	0.06
341	600885	宏发股份	66,300	2,109,666.00	0.06
342	603609	禾丰股份	243,900	2,102,418.00	0.06
343	605338	巴比食品	120,600	2,082,762.00	0.06
344	603169	兰石重装	382,000	2,081,900.00	0.06
345	603926	铁流股份	235,200	2,081,520.00	0.06
346	603317	天味食品	156,000	2,081,040.00	0.06
347	600681	百川能源	591,600	2,070,600.00	0.06
348	301267	华夏眼科	108,600	2,067,744.00	0.06
349	301109	军信股份	123,600	2,061,648.00	0.06
350	300065	海兰信	250,300	2,052,460.00	0.06
351	600032	浙江新能	276,500	2,046,100.00	0.06
352	603968	醋化股份	220,700	2,045,889.00	0.06
353	300815	玉禾田	131,100	2,043,849.00	0.06
354	000862	银星能源	412,400	2,037,256.00	0.06
355	300406	九强生物	151,800	2,028,048.00	0.06
356	300767	震安科技	223,900	2,019,578.00	0.06
357	002212	天融信	307,300	1,982,085.00	0.06
358	603022	新通联	269,700	1,968,810.00	0.06
359	603177	德创环保	266,600	1,962,176.00	0.06
360	000153	丰原药业	312,960	1,918,444.80	0.06
361	300160	秀强股份	350,400	1,906,176.00	0.06
362	600812	华北制药	363,900	1,881,363.00	0.06
363	600299	安迪苏	148,100	1,858,655.00	0.06
364	603089	正裕工业	205,800	1,846,026.00	0.06
365	603183	建研院	478,900	1,843,765.00	0.06
366	603301	振德医疗	83,800	1,842,762.00	0.06
367	002228	合兴包装	613,900	1,841,700.00	0.06
368	603357	设计总院	202,900	1,838,274.00	0.06
369	002144	宏达高科	175,900	1,831,119.00	0.06
370	600731	湖南海利	320,600	1,827,420.00	0.06
371	002412	汉森制药	303,800	1,825,838.00	0.06
372	603618	杭电股份	334,700	1,817,421.00	0.06
373	000554	泰山石油	305,400	1,814,076.00	0.06
374	688178	万德斯	144,823	1,808,839.27	0.06
375	600226	亨通股份	709,304	1,808,725.20	0.06
376	688663	新风光	83,160	1,805,403.60	0.06
377	603098	森特股份	188,000	1,804,800.00	0.06
378	002763	汇洁股份	271,500	1,802,760.00	0.06
379	601279	英利汽车	470,500	1,802,015.00	0.06

380	600110	诺德股份	449,200	1,796,800.00	0.06
381	600617	国新能源	663,900	1,792,530.00	0.06
382	603162	海通发展	194,100	1,785,720.00	0.05
383	000703	恒逸石化	282,000	1,770,960.00	0.05
384	002372	伟星新材	140,200	1,770,726.00	0.05
385	600051	宁波联合	270,600	1,769,724.00	0.05
386	600500	中化国际	439,900	1,768,398.00	0.05
387	002019	亿帆医药	164,400	1,762,368.00	0.05
388	603937	丽岛新材	194,500	1,762,170.00	0.05
389	603885	吉祥航空	128,600	1,761,820.00	0.05
390	301370	国科恒泰	162,700	1,757,160.00	0.05
391	300958	建工修复	152,500	1,756,800.00	0.05
392	605500	森林包装	251,600	1,751,136.00	0.05
393	688499	利元亨	77,881	1,742,197.97	0.05
394	688395	正弦电气	102,526	1,741,916.74	0.05
395	300193	佳士科技	195,800	1,740,662.00	0.05
396	300841	康华生物	31,800	1,733,736.00	0.05
397	600641	万业企业	118,500	1,732,470.00	0.05
398	300226	上海钢联	75,600	1,728,972.00	0.05
399	603383	顶点软件	46,100	1,728,750.00	0.05
400	601366	利群股份	339,110	1,715,896.60	0.05
401	002859	洁美科技	82,600	1,713,950.00	0.05
402	300996	普联软件	93,500	1,694,220.00	0.05
403	300595	欧普康视	89,100	1,688,445.00	0.05
404	601199	江南水务	297,500	1,645,175.00	0.05
405	688339	亿华通	68,154	1,642,511.40	0.05
406	601326	秦港股份	489,900	1,641,165.00	0.05
407	688669	聚石化学	106,291	1,641,133.04	0.05
408	002004	华邦健康	361,100	1,632,172.00	0.05
409	688370	丛麟科技	81,918	1,608,050.34	0.05
410	300579	数字认证	51,000	1,602,420.00	0.05
411	001277	速达股份	39,700	1,593,161.00	0.05
412	300232	洲明科技	230,000	1,580,100.00	0.05
413	002863	今飞凯达	334,300	1,551,152.00	0.05
414	603208	江山欧派	84,300	1,551,120.00	0.05
415	002088	鲁阳节能	120,300	1,538,637.00	0.05
416	688269	凯立新材	61,329	1,531,998.42	0.05
417	605068	明新旭腾	113,900	1,531,955.00	0.05
418	002534	西子洁能	137,100	1,523,181.00	0.05
419	001268	联合精密	87,200	1,522,512.00	0.05
420	002550	千红制药	244,700	1,517,140.00	0.05
421	600929	雪天盐业	271,300	1,516,567.00	0.05
422	002234	民和股份	170,400	1,514,856.00	0.05

423	002394	联发股份	200,800	1,510,016.00	0.05
424	603053	成都燃气	149,800	1,502,494.00	0.05
425	600917	重庆燃气	247,100	1,502,368.00	0.05
426	000920	沃顿科技	168,400	1,502,128.00	0.05
427	688291	金橙子	78,110	1,501,274.20	0.05
428	601869	长飞光纤	49,800	1,488,522.00	0.05
429	000531	穗恒运 A	258,200	1,487,232.00	0.05
430	601177	杭齿前进	179,600	1,487,088.00	0.05
431	603045	福达合金	116,400	1,482,936.00	0.05
432	002101	广东鸿图	123,600	1,480,728.00	0.05
433	603086	先达股份	345,396	1,478,294.88	0.05
434	003035	南网能源	351,900	1,470,942.00	0.05
435	002489	浙江永强	452,900	1,467,396.00	0.05
436	002666	德联集团	335,500	1,462,780.00	0.04
437	600821	金开新能	270,600	1,461,240.00	0.04
438	002801	微光股份	59,700	1,460,262.00	0.04
439	600328	中盐化工	184,640	1,453,116.80	0.04
440	002906	华阳集团	47,100	1,448,325.00	0.04
441	603601	再升科技	430,900	1,447,824.00	0.04
442	688215	瑞晟智能	70,963	1,430,614.08	0.04
443	600184	光电股份	138,000	1,424,160.00	0.04
444	300055	万邦达	296,500	1,420,235.00	0.04
445	603118	共进股份	159,000	1,415,100.00	0.04
446	300365	恒华科技	226,900	1,393,166.00	0.04
447	300993	玉马科技	120,300	1,358,187.00	0.04
448	002233	塔牌集团	172,800	1,325,376.00	0.04
449	605296	神农集团	47,750	1,322,675.00	0.04
450	300513	恒实科技	144,200	1,316,546.00	0.04
451	002091	江苏国泰	179,400	1,313,208.00	0.04
452	603071	物产环能	101,100	1,306,212.00	0.04
453	688280	精进电动	296,630	1,302,205.70	0.04
454	300051	珪升科技	194,500	1,301,205.00	0.04
455	002300	太阳电缆	242,200	1,293,348.00	0.04
456	603677	奇精机械	95,200	1,283,296.00	0.04
457	300485	赛升药业	180,100	1,262,501.00	0.04
458	002839	张家港行	287,400	1,255,938.00	0.04
459	603308	应流股份	88,500	1,247,850.00	0.04
460	603967	中创物流	126,600	1,241,946.00	0.04
461	603225	新凤鸣	111,400	1,239,882.00	0.04
462	002852	道道全	149,500	1,234,870.00	0.04
463	600020	中原高速	291,800	1,231,396.00	0.04
464	002393	力生制药	69,600	1,227,744.00	0.04
465	603506	南都物业	143,800	1,223,738.00	0.04

466	300371	汇中股份	127,500	1,222,725.00	0.04
467	600749	西藏旅游	113,600	1,217,792.00	0.04
468	603916	苏博特	162,700	1,213,742.00	0.04
469	600909	华安证券	199,700	1,210,182.00	0.04
470	603017	中衡设计	150,600	1,209,318.00	0.04
471	002548	金新农	304,300	1,208,071.00	0.04
472	603187	海容冷链	107,900	1,207,401.00	0.04
473	002731	萃华珠宝	128,300	1,204,737.00	0.04
474	603321	梅轮电梯	171,800	1,202,600.00	0.04
475	002492	恒基达鑫	249,800	1,201,538.00	0.04
476	600448	华纺股份	449,200	1,190,380.00	0.04
477	601003	柳钢股份	427,876	1,180,937.76	0.04
478	600222	太龙药业	231,100	1,176,299.00	0.04
479	603659	璞泰来	73,900	1,175,749.00	0.04
480	002051	中工国际	144,000	1,175,040.00	0.04
481	003022	联泓新科	85,100	1,171,827.00	0.04
482	002237	恒邦股份	116,000	1,171,600.00	0.04
483	300146	汤臣倍健	97,200	1,171,260.00	0.04
484	300662	科锐国际	55,600	1,170,936.00	0.04
485	000026	飞亚达	112,900	1,170,773.00	0.04
486	002522	浙江众成	299,100	1,169,481.00	0.04
487	603856	东宏股份	105,700	1,167,985.00	0.04
488	600790	轻纺城	310,900	1,165,875.00	0.04
489	300515	三德科技	97,700	1,163,607.00	0.04
490	002880	卫光生物	43,000	1,161,430.00	0.04
491	600862	中航高科	45,900	1,159,434.00	0.04
492	605189	富春染织	95,400	1,159,110.00	0.04
493	300978	东箭科技	106,100	1,155,429.00	0.04
494	603982	泉峰汽车	145,000	1,154,200.00	0.04
495	300438	鹏辉能源	41,000	1,152,510.00	0.04
496	300707	威唐工业	74,100	1,138,917.00	0.03
497	603787	新日股份	108,700	1,132,654.00	0.03
498	300369	绿盟科技	154,800	1,113,012.00	0.03
499	002818	富森美	73,400	1,096,596.00	0.03
500	301073	君亭酒店	52,100	1,087,327.00	0.03
501	688592	司南导航	28,747	1,075,137.80	0.03
502	301046	能辉科技	52,300	1,049,138.00	0.03
503	300800	力合科技	99,700	1,039,871.00	0.03
504	300616	尚品宅配	84,800	1,038,800.00	0.03
505	688536	思瑞浦	11,127	1,029,247.50	0.03
506	603730	岱美股份	113,700	1,022,163.00	0.03
507	600180	瑞茂通	235,700	1,013,510.00	0.03
508	300569	天能重工	201,500	1,003,470.00	0.03

509	600053	九鼎投资	71,700	994,479.00	0.03
510	688066	航天宏图	48,005	979,302.00	0.03
511	688026	洁特生物	76,147	976,966.01	0.03
512	688135	利扬芯片	48,181	966,992.67	0.03
513	688778	厦钨新能	21,142	964,920.88	0.03
514	600265	景谷林业	54,700	957,250.00	0.03
515	688238	和元生物	191,897	947,971.18	0.03
516	301268	铭利达	57,000	945,060.00	0.03
517	301239	普瑞眼科	20,100	942,690.00	0.03
518	300774	倍杰特	107,000	939,460.00	0.03
519	002546	新联电子	216,200	936,146.00	0.03
520	603348	文灿股份	39,500	934,570.00	0.03
521	002998	优彩资源	147,700	933,464.00	0.03
522	002674	兴业科技	97,900	929,071.00	0.03
523	301265	华新环保	103,600	928,256.00	0.03
524	301117	佳缘科技	30,300	928,089.00	0.03
525	600874	创业环保	155,300	927,141.00	0.03
526	600758	辽宁能源	269,000	925,360.00	0.03
527	603329	上海雅仕	71,700	924,213.00	0.03
528	001331	胜通能源	83,800	922,638.00	0.03
529	002968	新大正	99,400	915,474.00	0.03
530	605287	德才股份	75,200	913,680.00	0.03
531	601218	吉鑫科技	279,500	911,170.00	0.03
532	002585	双星新材	169,000	902,460.00	0.03
533	600668	尖峰集团	87,800	891,170.00	0.03
534	603396	金辰股份	33,100	890,390.00	0.03
535	600493	凤竹纺织	171,700	887,689.00	0.03
536	300970	华绿生物	74,300	884,170.00	0.03
537	301469	恒达新材	37,600	883,600.00	0.03
538	603010	万盛股份	85,900	882,193.00	0.03
539	002286	保龄宝	119,100	878,958.00	0.03
540	300343	联创股份	151,900	876,463.00	0.03
541	002414	高德红外	117,897	875,974.71	0.03
542	300610	晨化股份	87,400	874,000.00	0.03
543	603127	昭衍新药	52,500	873,075.00	0.03
544	603026	石大胜华	24,900	871,500.00	0.03
545	688172	燕东微	43,456	871,292.80	0.03
546	300009	安科生物	100,800	870,912.00	0.03
547	001333	光华股份	50,300	870,693.00	0.03
548	603876	鼎胜新材	98,300	869,955.00	0.03
549	002132	恒星科技	316,900	868,306.00	0.03
550	000156	华数传媒	120,300	866,160.00	0.03
551	300057	万顺新材	179,400	864,708.00	0.03

552	688636	智明达	30,743	863,878.30	0.03
553	600581	八一钢铁	279,800	858,986.00	0.03
554	002153	石基信息	120,100	857,514.00	0.03
555	688335	复洁环保	101,525	855,855.75	0.03
556	301319	唯特偶	29,345	855,700.20	0.03
557	000966	长源电力	176,400	837,900.00	0.03
558	688013	天臣医疗	47,417	835,013.37	0.03
559	003003	天元股份	86,600	832,226.00	0.03
560	688107	安路科技	28,093	830,990.94	0.03
561	002441	众业达	106,400	827,792.00	0.03
562	002809	红墙股份	104,000	824,720.00	0.03
563	688233	神工股份	31,998	750,353.10	0.02
564	601228	广州港	214,000	725,460.00	0.02
565	300653	正海生物	32,900	700,770.00	0.02
566	001316	润贝航科	23,400	678,600.00	0.02
567	002014	永新股份	61,300	671,848.00	0.02
568	688722	同益中	52,628	671,007.00	0.02
569	603680	今创集团	79,100	656,530.00	0.02
570	301349	信德新材	20,400	656,472.00	0.02
571	688317	之江生物	40,380	656,175.00	0.02
572	300514	友讯达	45,200	652,688.00	0.02
573	300439	美康生物	62,200	649,990.00	0.02
574	605177	东亚药业	32,600	642,220.00	0.02
575	002278	神开股份	118,400	631,072.00	0.02
576	301519	舜禹股份	46,700	630,917.00	0.02
577	600423	柳化股份	214,500	630,630.00	0.02
578	301190	善水科技	39,600	625,284.00	0.02
579	600235	民丰特纸	109,700	621,999.00	0.02
580	605033	美邦股份	51,500	619,545.00	0.02
581	002430	杭氧股份	28,300	616,940.00	0.02
582	301148	嘉戎技术	33,700	616,710.00	0.02
583	002671	龙泉股份	136,100	616,533.00	0.02
584	603811	诚意药业	79,700	615,284.00	0.02
585	301158	德石股份	43,700	613,111.00	0.02
586	002942	新农股份	43,400	612,808.00	0.02
587	301115	建科股份	43,700	611,363.00	0.02
588	688308	欧科亿	33,862	611,209.10	0.02
589	603158	腾龙股份	75,600	610,848.00	0.02
590	605369	拱东医疗	21,640	607,651.20	0.02
591	603176	汇通集团	136,300	606,535.00	0.02
592	605151	西上海	37,800	605,178.00	0.02
593	605303	园林股份	79,600	603,368.00	0.02
594	000856	冀东装备	87,300	602,370.00	0.02

595	002982	湘佳股份	33,700	601,545.00	0.02
596	603080	新疆火炬	37,400	601,392.00	0.02
597	600319	亚星化学	124,600	598,080.00	0.02
598	301379	天山电子	29,600	597,920.00	0.02
599	300998	宁波方正	40,100	597,891.00	0.02
600	300838	浙江力诺	47,200	597,552.00	0.02
601	002500	山西证券	95,100	597,228.00	0.02
602	002623	亚玛顿	38,600	595,598.00	0.02
603	002901	大博医疗	19,300	595,212.00	0.02
604	603639	海利尔	48,000	595,200.00	0.02
605	603380	易德龙	23,700	592,263.00	0.02
606	300867	圣元环保	45,700	590,901.00	0.02
607	603282	亚光股份	40,400	590,648.00	0.02
608	301108	洁雅股份	22,900	589,675.00	0.02
609	003008	开普检测	32,900	589,568.00	0.02
610	603289	泰瑞机器	71,400	589,050.00	0.02
611	688616	西力科技	56,628	588,364.92	0.02
612	301303	真兰仪表	38,400	588,288.00	0.02
613	300854	中兰环保	48,100	587,782.00	0.02
614	603579	荣泰健康	40,500	587,250.00	0.02
615	300834	星辉环材	29,700	586,872.00	0.02
616	603345	安井食品	7,200	586,656.00	0.02
617	688038	中科通达	48,282	586,626.30	0.02
618	300335	迪森股份	121,700	586,594.00	0.02
619	603151	邦基科技	58,600	586,586.00	0.02
620	688106	金宏气体	34,425	585,569.25	0.02
621	300463	迈克生物	44,300	584,760.00	0.02
622	603192	汇得科技	39,400	584,696.00	0.02
623	300837	浙矿股份	29,000	584,640.00	0.02
624	300886	华业香料	31,100	584,369.00	0.02
625	002128	电投能源	29,800	583,484.00	0.02
626	600763	通策医疗	13,081	580,796.40	0.02
627	301500	飞南资源	32,252	580,536.00	0.02
628	300871	回盛生物	57,700	580,462.00	0.02
629	002380	科远智慧	31,400	580,272.00	0.02
630	301272	英华特	16,800	579,768.00	0.02
631	688319	欧林生物	54,674	579,544.40	0.02
632	301307	美利信	28,500	579,405.00	0.02
633	688357	建龙微纳	26,416	579,302.88	0.02
634	301090	华润材料	83,300	578,102.00	0.02
635	300445	康斯特	35,400	575,958.00	0.02
636	600232	金鹰股份	110,100	575,823.00	0.02
637	600816	建元信托	164,300	575,050.00	0.02

638	688596	正帆科技	16,056	570,790.80	0.02
639	301180	万祥科技	36,300	561,561.00	0.02
640	300021	大禹节水	135,800	552,706.00	0.02
641	603685	晨丰科技	46,600	548,016.00	0.02
642	301022	海泰科	26,770	543,431.00	0.02
643	301029	怡合达	21,200	524,064.00	0.02
644	600883	博闻科技	79,500	520,725.00	0.02
645	688369	致远互联	25,173	505,222.11	0.02
646	001270	铖昌科技	13,200	502,920.00	0.02
647	688061	灿瑞科技	16,828	485,992.64	0.01
648	603538	美诺华	37,500	476,625.00	0.01
649	300429	强力新材	39,500	473,605.00	0.01
650	603829	洛凯股份	34,500	465,060.00	0.01
651	300480	光力科技	35,400	458,430.00	0.01
652	301258	富士莱	19,000	448,780.00	0.01
653	603612	索通发展	33,200	448,532.00	0.01
654	300985	致远新能	24,200	445,522.00	0.01
655	603070	万控智造	32,500	427,700.00	0.01
656	300747	锐科激光	22,300	427,268.00	0.01
657	688270	臻镭科技	12,178	426,230.00	0.01
658	301395	仁信新材	38,060	420,943.60	0.01
659	688697	纽威数控	23,127	384,833.28	0.01
660	002034	旺能环境	24,600	381,300.00	0.01
661	688348	昱能科技	7,805	380,884.00	0.01
662	603275	众辰科技	11,100	377,844.00	0.01
663	688321	微芯生物	20,107	373,588.06	0.01
664	688315	诺禾致源	29,379	367,237.50	0.01
665	301192	泰祥股份	20,000	348,200.00	0.01
666	300500	启迪设计	32,700	346,947.00	0.01
667	688179	阿拉丁	24,604	339,535.20	0.01
668	688295	中复神鹰	16,531	329,462.83	0.01
669	688285	高铁电气	43,760	323,824.00	0.01
670	688148	芳源股份	65,076	322,126.20	0.01
671	603909	建发合诚	35,000	320,600.00	0.01
672	600876	凯盛新能	33,400	316,966.00	0.01
673	002696	百洋股份	66,500	314,545.00	0.01
674	002825	纳尔股份	40,163	314,074.66	0.01
675	002110	三钢闽光	94,600	314,072.00	0.01
676	688371	菲沃泰	20,019	310,694.88	0.01
677	002753	永东股份	49,500	310,365.00	0.01
678	002365	永安药业	38,800	310,012.00	0.01
679	601007	金陵饭店	44,200	309,842.00	0.01
680	300196	长海股份	28,400	309,276.00	0.01

681	600980	北矿科技	20,200	308,656.00	0.01
682	603059	倍加洁	13,200	307,956.00	0.01
683	600488	津药药业	72,400	306,976.00	0.01
684	603280	南方路机	14,700	306,936.00	0.01
685	603600	永艺股份	25,800	306,762.00	0.01
686	000993	闽东电力	36,700	306,445.00	0.01
687	601330	绿色动力	46,700	306,352.00	0.01
688	600969	郴电国际	47,600	306,068.00	0.01
689	605008	长鸿高科	25,600	305,664.00	0.01
690	002299	圣农发展	21,100	305,528.00	0.01
691	301075	多瑞医药	17,000	305,490.00	0.01
692	300907	康平科技	14,500	305,080.00	0.01
693	001230	劲旅环境	18,400	305,072.00	0.01
694	605005	合兴股份	18,700	304,810.00	0.01
695	300257	开山股份	33,400	304,608.00	0.01
696	605288	凯迪股份	8,900	302,333.00	0.01
697	301098	金埔园林	38,000	302,100.00	0.01
698	688558	国盛智科	14,145	301,995.75	0.01
699	605058	澳弘电子	15,200	301,416.00	0.01
700	600486	扬农化工	5,200	300,924.00	0.01
701	688529	豪森智能	19,144	300,369.36	0.01
702	688067	爱威科技	17,742	296,646.24	0.01
703	301298	东利机械	21,500	296,270.00	0.01
704	605339	南侨食品	17,400	296,148.00	0.01
705	603043	广州酒家	17,800	296,014.00	0.01
706	600099	林海股份	33,600	295,680.00	0.01
707	002791	坚朗五金	13,000	295,620.00	0.01
708	300683	海特生物	12,400	295,616.00	0.01
709	300804	广康生化	13,100	295,536.00	0.01
710	600218	全柴动力	37,400	295,460.00	0.01
711	600371	万向德农	34,200	295,146.00	0.01
712	688455	科捷智能	26,892	294,736.32	0.01
713	688646	逸飞激光	8,733	294,389.43	0.01
714	301081	严牌股份	34,700	294,256.00	0.01
715	003017	大洋生物	15,800	294,196.00	0.01
716	301518	长华化学	18,300	294,081.00	0.01
717	002578	闽发铝业	98,300	293,917.00	0.01
718	300658	延江股份	56,700	293,706.00	0.01
719	688501	青达环保	20,924	293,563.72	0.01
720	002136	安纳达	30,100	293,475.00	0.01
721	688359	三孚新科	7,431	293,375.88	0.01
722	300132	青松股份	59,500	293,335.00	0.01
723	301515	港通医疗	16,300	293,074.00	0.01

724	001360	南矿集团	22,200	293,040.00	0.01
725	601969	海南矿业	41,300	292,817.00	0.01
726	300517	海波重科	34,800	292,668.00	0.01
727	002099	海翔药业	56,700	292,572.00	0.01
728	301196	唯科科技	8,900	292,543.00	0.01
729	688019	安集科技	2,097	292,237.92	0.01
730	301063	海锅股份	18,400	292,192.00	0.01
731	688468	科美诊断	42,652	292,166.20	0.01
732	601700	风范股份	64,900	292,050.00	0.01
733	002171	楚江新材	35,600	291,920.00	0.01
734	300126	锐奇股份	56,900	291,897.00	0.01
735	301234	五洲医疗	11,600	291,740.00	0.01
736	601778	晶科科技	103,400	291,588.00	0.01
737	001311	多利科技	11,300	291,427.00	0.01
738	300717	华信新材	20,900	291,137.00	0.01
739	301170	锡南科技	12,700	291,084.00	0.01
740	688292	浩瀚深度	14,691	290,881.80	0.01
741	001225	和泰机电	9,000	290,880.00	0.01
742	300519	新光药业	21,900	290,613.00	0.01
743	301429	森泰股份	18,700	290,598.00	0.01
744	301089	拓新药业	10,300	290,357.00	0.01
745	688092	爱科科技	14,161	290,300.50	0.01
746	688310	迈得医疗	26,844	289,915.20	0.01
747	300676	华大基因	6,900	289,593.00	0.01
748	688128	中国电研	13,761	289,118.61	0.01
749	688184	帕瓦股份	21,083	289,047.93	0.01
750	301528	多浦乐	7,400	288,600.00	0.01
751	300645	正元智慧	19,600	287,924.00	0.01
752	300620	光库科技	5,900	286,740.00	0.01
753	300712	永福股份	11,900	286,433.00	0.01
754	300095	华伍股份	41,800	283,822.00	0.01
755	000565	渝三峡 A	52,300	282,943.00	0.01
756	688171	纬德信息	16,398	274,338.54	0.01
757	001368	通达创智	14,400	271,584.00	0.01
758	688768	容知日新	7,398	268,843.32	0.01
759	003033	征和工业	9,500	255,075.00	0.01
760	688689	银河微电	11,951	253,241.69	0.01
761	688173	希荻微	21,277	235,749.16	0.01
762	300812	易天股份	10,200	224,808.00	0.01
763	688323	瑞华泰	18,148	223,038.92	0.01
764	300523	辰安科技	10,300	203,837.00	0.01
765	688023	安恒信息	4,775	194,820.00	0.01
766	300637	扬帆新材	20,600	189,520.00	0.01

767	688651	盛邦安全	5,301	187,496.37	0.01
768	688681	科汇股份	15,939	171,663.03	0.01
769	688707	振华新材	13,463	147,419.85	0.00
770	301273	瑞晨环保	8,000	146,320.00	0.00
771	688330	宏力达	4,312	113,146.88	0.00
772	605162	新中港	11,400	77,406.00	0.00
773	603709	中源家居	6,400	69,568.00	0.00
774	688597	煜邦电力	4,839	47,083.47	0.00
775	301072	中捷精工	1,300	24,622.00	0.00
776	000836	ST 富通	994,600	0.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600519	贵州茅台	365,925,027.17	3.59
2	000858	五粮液	237,973,352.31	2.33
3	000651	格力电器	231,550,474.57	2.27
4	600887	伊利股份	229,894,488.17	2.25
5	601318	中国平安	218,302,156.90	2.14
6	601288	农业银行	200,269,979.00	1.96
7	600900	长江电力	197,058,625.36	1.93
8	300760	迈瑞医疗	192,597,966.37	1.89
9	000333	美的集团	183,531,126.65	1.80
10	600919	江苏银行	176,555,671.64	1.73
11	300750	宁德时代	172,022,291.06	1.69
12	600418	江淮汽车	170,766,444.92	1.67
13	601328	交通银行	169,268,485.62	1.66
14	600941	中国移动	169,144,631.11	1.66
15	601857	中国石油	165,971,374.00	1.63
16	000725	京东方 A	158,768,205.00	1.56
17	000568	泸州老窖	151,406,116.22	1.48
18	601668	中国建筑	146,131,101.21	1.43
19	601658	邮储银行	144,231,117.00	1.41
20	601398	工商银行	134,778,515.10	1.32

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	337,895,124.87	3.31
2	000858	五粮液	226,477,765.27	2.22

3	601318	中国平安	216,612,259.44	2.12
4	601288	农业银行	201,987,862.80	1.98
5	600900	长江电力	200,551,523.45	1.97
6	300760	迈瑞医疗	187,070,083.02	1.83
7	000333	美的集团	182,802,132.00	1.79
8	601857	中国石油	181,817,586.00	1.78
9	000651	格力电器	179,746,174.22	1.76
10	600887	伊利股份	175,178,194.30	1.72
11	600418	江淮汽车	171,278,664.00	1.68
12	300750	宁德时代	170,402,564.34	1.67
13	600941	中国移动	169,632,599.51	1.66
14	601328	交通银行	168,041,639.56	1.65
15	000725	京东方 A	149,922,793.00	1.47
16	000568	泸州老窖	145,892,922.20	1.43
17	601319	中国人保	142,809,604.08	1.40
18	601668	中国建筑	142,401,866.97	1.40
19	601658	邮储银行	140,785,761.00	1.38
20	601398	工商银行	136,796,112.00	1.34

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	40,078,278,055.06
卖出股票收入（成交）总额	45,287,511,871.86

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,048,245.49
2	应收清算款	8,794,623.31
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,840,202.39
6	其他应收款	1,973.17
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,685,044.36

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国金量化多因子 A	111,666	10,547.88	314,675,783.80	26.72	863,164,186.50	73.28
国金量化多因子 C	26,419	16,416.72	63,231,286.23	14.58	370,482,155.50	85.42
合计	138,085	11,670.73	377,907,070.03	23.45	1,233,646,342.00	76.55

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金量化多因子 A	3,091,141.48	0.2624
	国金量化多因子 C	295,353.66	0.0681
	合计	3,386,495.14	0.2101

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金量化多因子 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

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
姚加红	公募基金	>100
	私募资产管理计划	10~50
	合计	>100

§ 10 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	894,184,029.44	673,623,148.32
减：本报告期基金总赎回份额	2,623,620,005.27	2,207,590,226.98
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,177,839,970.30	433,713,441.73

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

原督察长张静女士自 2024 年 11 月 20 日起由于个人原因离任基金管理人督察长职务，虞志海先生自 2024 年 11 月 20 日起担任基金管理人督察长职务。

除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，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。

除上述人事调整以外，本报告期内基金托管人无其他重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为 90,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	9,481,591,397.76	11.11	4,227,822.95	11.11	-
民生证券	2	7,723,060,631.08	9.05	3,443,719.48	9.05	-
广发证券	2	7,212,318,589.15	8.45	3,215,986.24	8.45	-
天风证券	1	5,385,377,999.67	6.31	2,401,354.01	6.31	-
西南证券	1	4,845,615,852.59	5.68	2,160,692.15	5.68	-
华泰证券	2	4,746,020,502.38	5.56	2,116,247.98	5.56	-
东北证券	1	4,602,097,659.55	5.39	2,052,101.55	5.39	-
中信建投证券	2	4,322,901,760.62	5.06	1,927,580.93	5.06	-
中信证券	2	3,693,678,669.86	4.33	1,647,023.12	4.33	-
国投证券	1	3,497,294,095.55	4.10	1,559,461.08	4.10	-
信达证券	1	3,484,046,677.45	4.08	1,553,516.42	4.08	-
银河证券	0	3,044,385,055.87	3.57	1,357,505.61	3.57	-

兴业证券	1	2,908,984,009.82	3.41	1,297,110.66	3.41	-
平安证券	1	2,650,388,997.42	3.10	1,181,792.38	3.10	-
招商证券	2	2,392,940,113.96	2.80	1,067,036.45	2.80	-
中国中金财富证券	1	1,952,643,913.57	2.29	870,697.32	2.29	-
山西证券	1	1,826,667,404.31	2.14	814,510.95	2.14	-
国信证券	1	1,404,023,566.76	1.64	626,062.56	1.64	-
东方财富证券	1	1,226,898,424.62	1.44	547,078.19	1.44	-
国金证券	1	1,224,793,574.80	1.43	546,127.21	1.43	-
国泰君安证券	2	1,093,249,616.12	1.28	487,478.80	1.28	-
华福证券	1	1,041,024,281.09	1.22	464,195.43	1.22	-
华金证券	1	981,123,890.39	1.15	437,492.20	1.15	-
第一创业证券	0	883,971,173.97	1.04	394,170.01	1.04	-
华安证券	1	842,631,648.01	0.99	375,726.81	0.99	-
浙商证券	1	836,013,690.09	0.98	372,774.89	0.98	-
恒泰证券	1	799,339,138.81	0.94	356,434.54	0.94	-
申万宏源证券	1	514,841,876.31	0.60	229,570.79	0.60	-
首创证券	1	407,735,906.40	0.48	181,809.63	0.48	-
华创证券	1	340,129,808.94	0.40	151,665.30	0.40	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：（一）选择标准

1. 具备相关业务资质，公司经营行为规范；
2. 财务状况良好，公司经营状况稳定；
3. 具备较强的交易服务能力，相关制度建设、人员配置、系统建设等满足基金进行证券交易的
需要；
4. 具备较强的研究服务能力，相关制度建设、人员配置、研究能力、研究质量等可以保障较
为专业、审慎的研究服务；
5. 具备较强的合规风控能力，合规风控管理体系机制较为健全；
6. 交易佣金费率标准符合要求。

（二）选择程序

1. 基金管理人根据上述标准选用符合条件的证券公司；
2. 基金管理人和被选用的证券公司签订协议。

（三）变更情况

本基金本报告期新增民生证券、银河证券、华金证券、华安证券、国联证券、申万宏源证
券、中泰证券、光大证券、国海证券共 9 个交易单元，减少国新证券、第一创业证券、江海证
券、方正证券、华西证券、国金证券、银河证券共 11 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例(%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
长江证 券	55,681,777 .23	17.72	472,045,000. 00	8.95	-	-
民生证 券	-	-	762,918,000. 00	14.46	-	-
广发证 券	-	-	256,328,000. 00	4.86	-	-
天风证 券	-	-	253,300,000. 00	4.80	-	-
西南证 券	-	-	365,788,000. 00	6.93	-	-

华泰证 券	16,994,038 .14	5.41	281,300,000. 00	5.33	-	-
东北证 券	-	-	214,610,000. 00	4.07	-	-
中信建 投证券	-	-	214,100,000. 00	4.06	-	-
中信证 券	-	-	349,612,000. 00	6.63	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	179,100,000. 00	3.40	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	177,400,000. 00	3.36	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	395,602,000. 00	7.50	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	241,633,01 2.80	76.88	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	438,939,000. 00	8.32	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	296,100,000. 00	5.61	-	-
浙商证 券	-	-	202,300,000. 00	3.84	-	-
恒泰证	-	-	-	-	-	-

券						
申万宏源证券	-	-	332,245,000.00	6.30	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	83,278,000.00	1.58	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国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）	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 02 月 06 日

	基金产品资料概要更新》		
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 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 04 月 16 日
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
16	《国金量化多因子股票型证券投资 基金 2024 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 07 月 19 日
17	《国金基金管理有限公司关于终止 中民财富基金销售（上海）有限公 司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 08 月 29 日
18	《国金量化多因子股票型证券投资 基金 2024 年中期报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 08 月 31 日
19	《关于调整国金量化多因子股票型 证券投资基金单笔申购及定期定额 申购最低金额的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 09 月 13 日
20	《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 10 月 17 日
21	《国金量化多因子股票型证券投资 基金 2024 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
22	《国金基金管理有限公司关于暂停 海银基金销售有限公司办理旗下基 金相关业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 11 月 05 日
23	《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 11 月 14 日
24	《国金基金管理有限公司高级管理 人员变更公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 11 月 21 日
25	《国金基金管理有限公司关于本公 司住所变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 11 月 23 日
26	《国金基金管理有限公司关于终止	指定披露媒体和本基金	2024 年 12 月 20 日

	北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告》	基金管理人网站	
27	《国金基金管理有限公司关于关闭微信交易平台开户、认购、申购（含定期定额投资）、转换业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 12 月 27 日
28	《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 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会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。

13.2 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。

13.3 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

2025 年 3 月 28 日