

国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60

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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 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	1,793,844,775.33 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	902,593,669.52 份	891,251,105.81 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	$85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中证全债指数收益率}$
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(2025 年 1 月 1 日-2025 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	241,571,643.53	127,242,153.20
本期利润	394,411,511.62	230,054,151.43
加权平均基金份 额本期利润	0.3815	0.4721
本期加权平均净 值利润率	17.84%	21.87%
本期基金份额净 值增长率	20.02%	19.79%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	937,507,161.96	867,988,644.09
期末可供分配基 金份额利润	1.0387	0.9739

期末基金资产净值	2,195,087,349.87	2,144,802,077.66
期末基金份额净值	2.4320	2.4065
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	143.20%	38.50%

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	7.02%	0.65%	3.75%	0.67%	3.27%	-0.02%
过去三个月	13.76%	1.30%	1.23%	1.26%	12.53%	0.04%
过去六个月	20.02%	1.14%	3.14%	1.14%	16.88%	0.00%
过去一年	39.18%	1.48%	18.00%	1.46%	21.18%	0.02%
过去三年	36.18%	1.37%	-4.01%	1.15%	40.19%	0.22%
自基金合同生效起至今	143.20%	1.29%	43.45%	1.18%	99.75%	0.11%

国金量化多因子 C

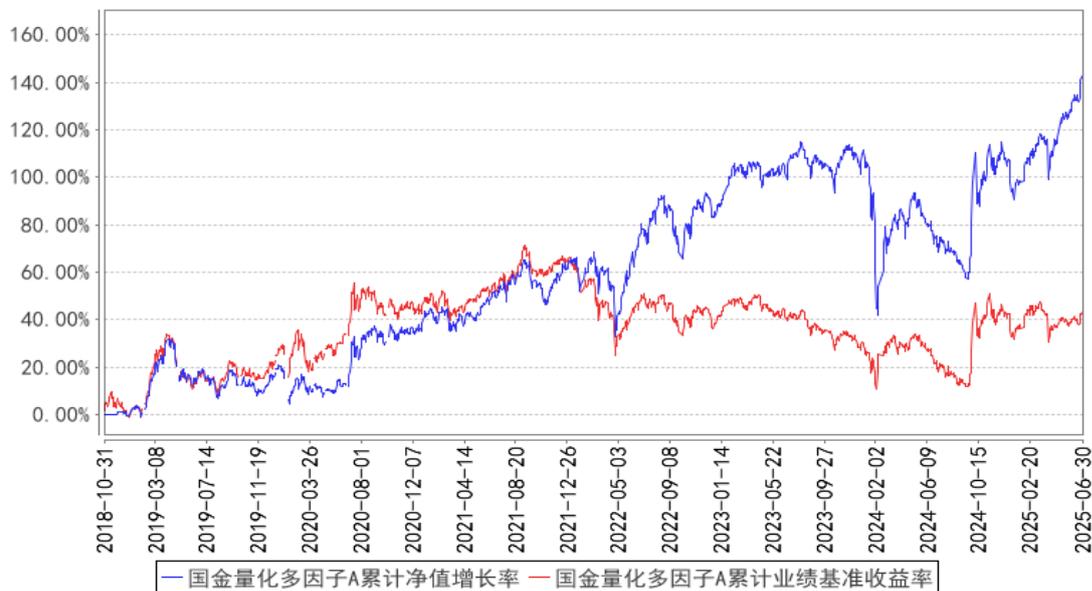
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.99%	0.65%	3.75%	0.67%	3.24%	-0.02%
过去三个月	13.65%	1.30%	1.23%	1.26%	12.42%	0.04%

过去六个月	19.79%	1.14%	3.14%	1.14%	16.65%	0.00%
过去一年	38.62%	1.48%	18.00%	1.46%	20.62%	0.02%
自基金合同生效 起至今	38.50%	1.38%	4.29%	1.16%	34.21%	0.22%

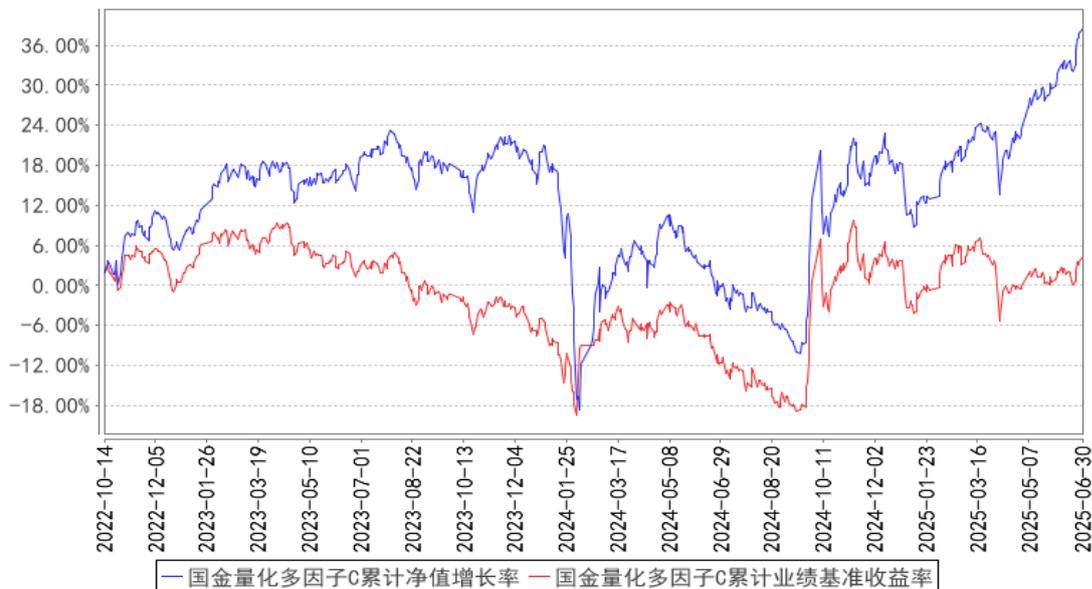
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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 2025 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

2025 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至2025年6月30日，国金基金管理有限公司共管理28只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证1000指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国金中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金、国金中证A500指数增强型证券投资基金、国金安瑞平衡混合型证券投资基金。

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	-	9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	-	21 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	6,870,829,155.45	2023 年 1 月 5 日
	私募资产管理计划	5	182,605,312.35	2016 年 4 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	7,053,434,467.80	-

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。

4.2 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，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场环境方面，2025 年上半年的市场活跃度处于近五年平均水平以上位置，但低于 2024 年四季度平均水平。市场风格方面，大部分风格波动与近五年平均水平相当，但贝塔值波动相对较高，特别是今年 4 月初，该风格波动与 2024 年 9 月较为极致的水平相当。报告期内，主要市场风格因子（如贝塔值和动量等）切换较为剧烈，持续性差；市值类因子波动相对较小，延续性较强。行业涨跌方面，大部分中信一级行业在报告期内录得正收益，其中涨幅大于 15%的行业为综合金融、有色金属和银行，跌幅大于 5%的行业为煤炭、房地产和食品饮料。

报告期内，本基金采用的量化策略与风险模型适配性增强，本基金相对收益的波动有所降低，主要原因是：报告期内市场流动性良好，相对分散的市场机会提供了较为均衡的收益来源，一定程度上利于相对收益的稳定性提升。

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 2.4320 元，累计单位净值为 2.4320 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 20.02%，同期业绩比较基准增长率为 3.14%。

本基金 C 类份额单位净值为 2.4065 元，累计单位净值为 2.4065 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 19.79%，同期业绩比较基准增长率为 3.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在预期货币政策适度宽松、增量资金入场的背景下，市场流动性或保持充裕。政策催化和产业技术突破等有望共同驱动结构性投资机会，此类市场环境或为超额收益的积累提供基础。但上述条件均存在不确定性因素，仍需密切关注下半年的市场风险。

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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	249,221,776.88	200,028,445.58
结算备付金		33,069,616.03	17,820,121.14
存出保证金		1,086,995.44	1,048,245.49
交易性金融资产	6.4.7.2	3,938,236,248.06	2,900,625,370.54
其中：股票投资		3,938,236,248.06	2,900,625,370.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	86,100,000.00	172,837,240.57
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		41,383,774.26	8,794,623.31
应收股利		-	-
应收申购款		36,065,159.16	2,840,202.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,973.17
资产总计		4,385,163,569.83	3,303,996,222.19

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,953,510.28	4,148,987.80
应付赎回款		20,555,924.18	18,615,597.63
应付管理人报酬		3,841,288.11	3,515,497.79
应付托管费		640,214.67	585,916.32
应付销售服务费		613,838.14	325,335.80
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	15,669,366.92	18,843,239.43
负债合计		45,274,142.30	46,034,574.77
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,793,844,775.33	1,611,553,412.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,546,044,652.20	1,646,408,235.39
净资产合计		4,339,889,427.53	3,257,961,647.42
负债和净资产总计		4,385,163,569.83	3,303,996,222.19

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，国金量化多因子 A 基金份额净值 2.4320 元，基金份额总额 902,593,669.52 份；国金量化多因子 C 基金份额净值 2.4065 元，基金份额总额 891,251,105.81 份。国金量化多因子份额总额合计为 1,793,844,775.33 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		649,271,263.88	-1,762,744,436.56
1. 利息收入		1,365,973.35	692,251.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	489,718.35	648,247.65
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		876,255.00	44,004.33
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		391,288,237.65	-1,685,044,636.00
其中：股票投资收益	6.4.7.14	360,493,577.57	-1,728,622,395.94
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	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	30,794,660.08	40,499,591.19
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	255,651,866.32	-83,709,522.27
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	965,186.56	5,317,469.73
减：二、营业总支出		24,805,600.83	43,103,055.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,375,304.03	33,427,162.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,229,217.34	5,571,193.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,069,781.34	3,959,043.97
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	131,298.12	145,655.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		624,465,663.05	-1,805,847,492.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		624,465,663.05	-1,805,847,492.33

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		624,465,663.05	-1,805,847,492.33

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,611,553,412.03	-	1,646,408,235.39	3,257,961,647.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,611,553,412.03	-	1,646,408,235.39	3,257,961,647.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	182,291,363.30	-	899,636,416.81	1,081,927,780.11
(一)、综合收益总额	-	-	624,465,663.05	624,465,663.05
(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)	182,291,363.30	-	275,170,753.76	457,462,117.06
其中：1. 基金申购款	1,051,606,019.12	-	1,292,168,556.14	2,343,774,575.26
2. 基金赎回款	-869,314,655.82	-	-1,016,997,802.38	-1,886,312,458.20
(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	1,793,844,775.33	-	2,546,044,652.20	4,339,889,427.53
项目	上年度可比期间 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	6,393,900,434.17
(一)、综合收益总额	-	-	1,805,847,492.33	1,805,847,492.33
(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	4,588,052,941.84
其中：1. 基金申购款	955,357,545.33	-	767,650,289.38	1,723,007,834.71
2. 基金赎回款	3,650,120,042.51	-	2,660,940,734.04	6,311,060,776.55

(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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金量化多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%×中证 500 指数收益率+15%×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、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 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。

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 2025年6月30日
活期存款	249,221,776.88
等于：本金	249,191,945.43
加：应计利息	29,831.45
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	249,221,776.88

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,748,482,350.58	-	3,938,236,248.06	189,753,897.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,748,482,350.58	-	3,938,236,248.06	189,753,897.48

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

无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	86,100,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	86,100,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.8 其他资产

无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,977.52
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,561,251.05
其中：交易所市场	15,561,251.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,138.35
合计	15,669,366.92

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 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,177,839,970.30	1,177,839,970.30
本期申购	286,098,869.67	286,098,869.67
本期赎回（以“-”号填列）	-561,345,170.45	-561,345,170.45
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	902,593,669.52	902,593,669.52

国金量化多因子 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	433,713,441.73	433,713,441.73
本期申购	765,507,149.45	765,507,149.45
本期赎回（以“-”号填列）	-307,969,485.37	-307,969,485.37
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	891,251,105.81	891,251,105.81

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

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	939,604,794.59	269,184,126.59	1,208,788,921.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	939,604,794.59	269,184,126.59	1,208,788,921.18
本期利润	241,571,643.53	152,839,868.09	394,411,511.62
本期基金份额交易产生的变动数	-243,669,276.16	-67,037,476.29	-310,706,752.45
其中：基金申购款	267,039,315.42	83,203,778.83	350,243,094.25
基金赎回款	-510,708,591.58	-150,241,255.12	-660,949,846.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	937,507,161.96	354,986,518.39	1,292,493,680.35

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	320,723,153.71	116,896,160.50	437,619,314.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	320,723,153.71	116,896,160.50	437,619,314.21
本期利润	127,242,153.20	102,811,998.23	230,054,151.43
本期基金份额交易产生的变动数	420,023,337.18	165,854,169.03	585,877,506.21
其中：基金申购款	678,976,307.20	262,949,154.69	941,925,461.89
基金赎回款	-258,952,970.02	-97,094,985.66	-356,047,955.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	867,988,644.09	385,562,327.76	1,253,550,971.85

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	389,308.68
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	43,924.59
其他	56,485.08
合计	489,718.35

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	360,493,577.57
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	360,493,577.57

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	11,613,098,512.26
减：卖出股票成本总额	11,234,746,676.06
减：交易费用	17,858,258.63
买卖股票差价收入	360,493,577.57

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	30,794,660.08
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	30,794,660.08

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	255,651,866.32
股票投资	255,651,866.32
债券投资	-
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	255,651,866.32

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	759,425.35
基金转换费收入	205,761.21
合计	965,186.56

6.4.7.22 信用减值损失

无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	27,159.77
合计	131,298.12

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至 2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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 2025年1月1日至2025年 6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）

-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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

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。

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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,375,304.03	33,427,162.66
其中：应支付销售机构的客户维 护费	6,068,465.66	11,036,433.64
应支付基金管理人的净管理费	13,306,838.37	22,390,729.02

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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,229,217.34	5,571,193.78

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	547,704.55	547,704.55
国金证券股份有限公司	-	89,423.41	89,423.41
合计	-	637,127.96	637,127.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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

无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无

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

无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	249,221,776.88	389,308.68	107,549,614.81	403,336.59

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股	停牌	停	期末	复	复牌	数量	期末	期末	备
------	---	----	---	----	---	----	----	----	----	---

码	票名称	日期	牌原因	估值单价	牌日期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	注
603863	松炆资源	2025年6月27日	重大事项停牌	14.65	2025年7月4日	13.45	350,900	4,915,837.00	5,140,685.00	-

注：于 2025 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

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

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

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

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

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

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 2025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	249,221,776.88	-	-	-	-	-	249,221,776.88
结算备付金	33,069,616.03	-	-	-	-	-	33,069,616.03
存出保证金	1,086,995.44	-	-	-	-	-	1,086,995.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,938,236,248.06	3,938,236,248.06
买入返售金融资产	86,100,000.00	-	-	-	-	-	86,100,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	41,383,774.26	41,383,774.26
应收申购款	-	-	-	-	-	36,065,159.16	36,065,159.16
资产总计	369,478,388.35	-	-	-	-	4,015,685,181.48	4,385,163,569.83
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	3,953,510.28	3,953,510.28
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,555,924.18	20,555,924.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,841,288.11	3,841,288.11
应付托管费	-	-	-	-	-	640,214.67	640,214.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	613,838.14	613,838.14
其他负债	-	-	-	-	-	15,669,366.92	15,669,366.92
负债总计	-	-	-	-	-	45,274,142.30	45,274,142.30
利率敏感度缺口	369,478,388.35	-	-	-	-	3,970,411,039.18	4,339,889,427.53
上年度末 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

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量 and 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 2025年6月30日		上年度末 2024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	3,938,236,248.06	90.75	2,900,625,370.54	89.03

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,938,236,248.06	90.75	2,900,625,370.54	89.03

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数（000905.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	+5%	172,796,705.38	132,647,957.69
	-5%	-172,796,705.38	-132,647,957.69

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	3,933,095,563.06	2,900,625,370.54
第二层次	5,140,685.00	-
第三层次	-	-
合计	3,938,236,248.06	2,900,625,370.54

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	3,938,236,248.06	89.81
	其中：股票	3,938,236,248.06	89.81
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	86,100,000.00	1.96
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	282,291,392.91	6.44
8	其他各项资产	78,535,928.86	1.79
9	合计	4,385,163,569.83	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	33,346,209.32	0.77
B	采矿业	127,311,183.77	2.93
C	制造业	2,144,076,029.47	49.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	166,561,031.12	3.84
E	建筑业	131,637,449.70	3.03
F	批发和零售业	100,186,649.03	2.31
G	交通运输、仓储和邮政业	94,309,325.60	2.17
H	住宿和餐饮业	7,063,005.42	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	407,454,797.83	9.39
J	金融业	458,070,517.22	10.55
K	房地产业	57,531,431.00	1.33
L	租赁和商务服务业	39,734,185.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	103,553,265.68	2.39
N	水利、环境和公共设施管理业	43,837,720.90	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	1,185,021.00	0.03
P	教育	387,660.00	0.01
Q	卫生和社会工作	3,587,850.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	17,233,384.00	0.40
S	综合	1,169,532.00	0.03
	合计	3,938,236,248.06	90.75

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	757,000	101,725,660.00	2.34
2	601162	天风证券	13,752,000	67,797,360.00	1.56

3	300033	同花顺	238,610	65,142,916.10	1.50
4	002384	东山精密	1,722,000	65,039,940.00	1.50
5	300548	长芯博创	936,300	62,516,751.00	1.44
6	601336	新华保险	1,023,400	59,868,900.00	1.38
7	300274	阳光电源	872,540	59,132,035.80	1.36
8	000651	格力电器	1,314,800	59,060,816.00	1.36
9	688008	澜起科技	718,143	58,887,726.00	1.36
10	300418	昆仑万维	1,743,400	58,630,542.00	1.35
11	603259	药明康德	818,241	56,908,661.55	1.31
12	600926	杭州银行	3,342,004	56,212,507.28	1.30
13	601668	中国建筑	9,726,500	56,121,905.00	1.29
14	002466	天齐锂业	1,716,440	54,994,737.60	1.27
15	600941	中国移动	482,000	54,249,100.00	1.25
16	603799	华友钴业	1,329,030	49,200,690.60	1.13
17	000338	潍柴动力	3,116,200	47,927,156.00	1.10
18	601919	中远海控	3,023,090	45,467,273.60	1.05
19	600096	云天化	1,945,000	42,731,650.00	0.98
20	002460	赣锋锂业	1,253,880	42,343,527.60	0.98
21	600938	中国海油	1,568,500	40,953,535.00	0.94
22	605499	东鹏饮料	120,500	37,843,025.00	0.87
23	600795	国电电力	7,730,100	37,413,684.00	0.86
24	000988	华工科技	788,900	37,086,189.00	0.85
25	002463	沪电股份	863,302	36,759,399.16	0.85
26	002966	苏州银行	3,820,930	33,547,765.40	0.77
27	301236	软通动力	610,600	33,363,184.00	0.77
28	601717	中创智领	1,933,000	32,126,460.00	0.74
29	600699	均胜电子	1,798,200	31,360,608.00	0.72
30	000750	国海证券	6,967,500	28,706,100.00	0.66
31	600438	通威股份	1,521,200	25,480,100.00	0.59
32	600011	华能国际	3,539,100	25,269,174.00	0.58
33	600066	宇通客车	969,824	24,109,824.64	0.56
34	600027	华电国际	4,406,300	24,102,461.00	0.56
35	600120	浙江东方	3,775,964	22,844,582.20	0.53
36	601128	常熟银行	3,092,908	22,794,731.96	0.53
37	601898	中煤能源	2,054,800	22,479,512.00	0.52
38	300558	贝达药业	355,100	20,578,045.00	0.47
39	601360	三六零	1,979,300	20,188,860.00	0.47
40	002459	晶澳科技	1,894,600	18,908,108.00	0.44
41	601519	大智慧	1,815,800	18,503,002.00	0.43
42	300763	锦浪科技	305,500	17,532,645.00	0.40
43	600183	生益科技	561,900	16,941,285.00	0.39
44	300014	亿纬锂能	363,800	16,665,678.00	0.38
45	601117	中国化学	2,052,900	15,745,743.00	0.36

46	300496	中科创达	272,800	15,609,616.00	0.36
47	000963	华东医药	366,000	14,771,760.00	0.34
48	002670	国盛金控	972,500	14,636,125.00	0.34
49	600029	南方航空	2,400,200	14,161,180.00	0.33
50	600115	中国东航	3,400,500	13,704,015.00	0.32
51	688800	瑞可达	276,959	13,626,382.80	0.31
52	000513	丽珠集团	373,869	13,474,238.76	0.31
53	601688	华泰证券	748,100	13,323,661.00	0.31
54	600348	华阳股份	1,906,100	12,694,626.00	0.29
55	301191	菲菱科思	136,700	11,861,459.00	0.27
56	600021	上海电力	1,337,900	11,760,141.00	0.27
57	600583	海油工程	2,131,000	11,635,260.00	0.27
58	600578	京能电力	2,577,400	11,572,526.00	0.27
59	000538	云南白药	198,760	11,088,820.40	0.26
60	300369	绿盟科技	1,358,812	10,557,969.24	0.24
61	300025	华星创业	1,519,200	10,543,248.00	0.24
62	601001	晋控煤业	861,100	10,522,642.00	0.24
63	600820	隧道股份	1,670,400	10,189,440.00	0.23
64	601375	中原证券	2,379,500	9,898,720.00	0.23
65	002945	华林证券	674,300	9,689,691.00	0.22
66	601198	东兴证券	857,900	9,565,585.00	0.22
67	300229	拓尔思	518,500	9,561,140.00	0.22
68	300024	机器人	539,900	9,275,482.00	0.21
69	600039	四川路桥	927,503	9,182,279.70	0.21
70	000825	太钢不锈	2,531,900	9,089,521.00	0.21
71	600609	金杯汽车	1,651,000	8,733,790.00	0.20
72	002331	皖通科技	1,037,700	8,353,485.00	0.19
73	300659	中孚信息	570,229	8,291,129.66	0.19
74	002080	中材科技	419,500	8,180,250.00	0.19
75	601990	南京证券	999,366	8,074,877.28	0.19
76	000829	天音控股	779,700	7,960,737.00	0.18
77	000937	冀中能源	1,356,201	7,798,155.75	0.18
78	301266	宇邦新材	224,500	7,505,035.00	0.17
79	000060	中金岭南	1,631,744	7,473,387.52	0.17
80	000157	中联重科	1,011,400	7,312,422.00	0.17
81	301251	威尔高	186,200	7,300,902.00	0.17
82	002624	完美世界	480,700	7,292,219.00	0.17
83	600635	大众公用	1,865,700	7,276,230.00	0.17
84	688425	铁建重工	1,778,950	7,258,116.00	0.17
85	600582	天地科技	1,208,700	7,240,113.00	0.17
86	601918	新集能源	1,109,200	7,165,432.00	0.17
87	301123	奕东电子	308,800	7,043,728.00	0.16
88	002712	思美传媒	1,179,700	6,924,839.00	0.16

89	002037	保利联合	750,000	6,855,000.00	0.16
90	601298	青岛港	775,000	6,734,750.00	0.16
91	000802	北京文化	1,388,600	6,693,052.00	0.15
92	002061	浙江交科	1,637,700	6,485,292.00	0.15
93	000823	超声电子	544,600	6,453,510.00	0.15
94	300667	必创科技	407,800	6,439,162.00	0.15
95	300552	万集科技	228,900	6,372,576.00	0.15
96	300098	高新兴	1,221,200	6,350,240.00	0.15
97	600351	亚宝药业	1,029,900	6,251,493.00	0.14
98	600969	郴电国际	870,200	6,213,228.00	0.14
99	600152	维科技术	814,000	6,194,540.00	0.14
100	688244	永信至诚	234,825	6,180,594.00	0.14
101	300902	国安达	317,700	5,979,114.00	0.14
102	002885	京泉华	421,900	5,969,885.00	0.14
103	300074	华平股份	1,218,900	5,948,232.00	0.14
104	300365	恒华科技	898,700	5,922,433.00	0.14
105	300904	威力传动	108,500	5,891,550.00	0.14
106	002772	众兴菌业	728,600	5,690,366.00	0.13
107	002405	四维图新	662,800	5,660,312.00	0.13
108	600873	梅花生物	525,100	5,613,319.00	0.13
109	300036	超图软件	363,800	5,551,588.00	0.13
110	603399	永杉锂业	594,800	5,490,004.00	0.13
111	000863	三湘印象	1,552,900	5,450,679.00	0.13
112	301169	零点有数	131,100	5,438,028.00	0.13
113	600640	国脉文化	446,300	5,409,156.00	0.12
114	001283	豪鹏科技	99,300	5,406,885.00	0.12
115	002030	达安基因	893,600	5,406,280.00	0.12
116	301510	固高科技	177,300	5,327,865.00	0.12
117	002589	瑞康医药	1,796,600	5,317,936.00	0.12
118	601568	北元集团	1,273,070	5,283,240.50	0.12
119	600808	马钢股份	1,522,100	5,251,245.00	0.12
120	688981	中芯国际	59,224	5,221,780.08	0.12
121	002350	北京科锐	750,200	5,146,372.00	0.12
122	603863	松炆资源	350,900	5,140,685.00	0.12
123	300996	普联软件	339,660	5,105,089.80	0.12
124	002160	常铝股份	1,159,000	5,006,880.00	0.12
125	603803	瑞斯康达	496,400	4,983,856.00	0.11
126	300538	同益股份	311,200	4,923,184.00	0.11
127	600380	健康元	443,800	4,895,114.00	0.11
128	603600	永艺股份	459,600	4,890,144.00	0.11
129	603138	海量数据	336,200	4,848,004.00	0.11
130	002796	世嘉科技	410,200	4,840,360.00	0.11
131	300150	世纪瑞尔	963,444	4,836,488.88	0.11

132	002912	中新赛克	201,000	4,793,850.00	0.11
133	688095	福昕软件	69,989	4,752,952.99	0.11
134	002692	远程股份	961,200	4,748,328.00	0.11
135	002771	真视通	284,600	4,741,436.00	0.11
136	601456	国联民生	457,400	4,734,090.00	0.11
137	600697	欧亚集团	389,600	4,714,160.00	0.11
138	603386	骏亚科技	371,400	4,698,210.00	0.11
139	600628	新世界	636,900	4,662,108.00	0.11
140	002608	江苏国信	627,500	4,599,575.00	0.11
141	301608	博实结	51,535	4,590,737.80	0.11
142	002382	蓝帆医疗	819,199	4,587,514.40	0.11
143	300214	日科化学	670,000	4,549,300.00	0.10
144	300112	万讯自控	500,900	4,533,145.00	0.10
145	601101	昊华能源	626,000	4,532,240.00	0.10
146	300050	世纪鼎利	790,900	4,531,857.00	0.10
147	002362	汉王科技	200,500	4,495,210.00	0.10
148	300605	恒锋信息	301,100	4,492,412.00	0.10
149	002995	天地在线	232,000	4,489,200.00	0.10
150	601666	平煤股份	603,722	4,473,580.02	0.10
151	688057	金达莱	363,329	4,432,613.80	0.10
152	002865	钧达股份	112,900	4,403,100.00	0.10
153	600613	神奇制药	680,700	4,397,322.00	0.10
154	300583	赛托生物	254,500	4,387,580.00	0.10
155	301218	华是科技	205,600	4,383,392.00	0.10
156	002616	长青集团	736,800	4,376,592.00	0.10
157	002949	华阳国际	324,400	4,372,912.00	0.10
158	000619	海螺新材	721,100	4,355,444.00	0.10
159	300585	奥联电子	274,600	4,352,410.00	0.10
160	300560	中富通	322,000	4,350,220.00	0.10
161	600581	八一钢铁	1,411,900	4,320,414.00	0.10
162	002578	闽发铝业	1,288,300	4,315,805.00	0.10
163	601865	福莱特	280,500	4,266,405.00	0.10
164	688339	亿华通	199,350	4,256,122.50	0.10
165	600004	白云机场	466,900	4,248,790.00	0.10
166	000568	泸州老窖	37,400	4,241,160.00	0.10
167	003007	直真科技	140,850	4,229,725.50	0.10
168	600479	千金药业	405,900	4,221,360.00	0.10
169	300195	长荣股份	593,500	4,219,785.00	0.10
170	002746	仙坛股份	722,600	4,205,532.00	0.10
171	600267	海正药业	453,317	4,193,182.25	0.10
172	601686	友发集团	733,820	4,168,097.60	0.10
173	300751	迈为股份	59,772	4,157,740.32	0.10
174	300883	龙利得	667,400	4,151,228.00	0.10

175	300616	尚品宅配	314,500	4,141,965.00	0.10
176	600257	大湖股份	801,300	4,134,708.00	0.10
177	300686	智动力	411,900	4,114,881.00	0.09
178	002184	海得控制	313,800	4,110,780.00	0.09
179	603729	龙韵股份	239,300	4,096,816.00	0.09
180	603861	白云电器	414,100	4,087,167.00	0.09
181	600660	福耀玻璃	71,600	4,081,916.00	0.09
182	600503	华丽家族	1,620,100	4,066,451.00	0.09
183	603717	天域生物	558,920	4,052,170.00	0.09
184	000586	汇源通信	364,100	4,048,792.00	0.09
185	001324	长青科技	204,500	4,028,650.00	0.09
186	300615	欣天科技	300,300	4,015,011.00	0.09
187	601609	金田股份	572,300	4,011,823.00	0.09
188	601002	晋亿实业	808,700	3,986,891.00	0.09
189	300590	移为通信	305,400	3,973,254.00	0.09
190	300966	共同药业	216,500	3,968,445.00	0.09
191	000428	华天酒店	1,183,500	3,929,220.00	0.09
192	000751	锌业股份	1,251,170	3,928,673.80	0.09
193	002548	金新农	1,033,600	3,927,680.00	0.09
194	002926	华西证券	439,100	3,925,554.00	0.09
195	600510	黑牡丹	769,700	3,917,773.00	0.09
196	000797	中国武夷	1,453,100	3,908,839.00	0.09
197	300242	佳云科技	812,900	3,901,920.00	0.09
198	688435	英方软件	118,381	3,899,470.14	0.09
199	300830	金现代	426,600	3,894,858.00	0.09
200	300612	宣亚国际	257,600	3,889,760.00	0.09
201	000757	浩物股份	856,800	3,881,304.00	0.09
202	002999	天禾股份	555,200	3,875,296.00	0.09
203	601231	环旭电子	264,800	3,874,024.00	0.09
204	002454	松芝股份	498,600	3,849,192.00	0.09
205	002725	跃岭股份	291,300	3,839,334.00	0.09
206	000570	苏常柴 A	662,900	3,838,191.00	0.09
207	002081	金螳螂	1,117,000	3,831,310.00	0.09
208	301126	达嘉维康	345,300	3,829,377.00	0.09
209	300780	德恩精工	236,700	3,808,503.00	0.09
210	000166	申万宏源	753,700	3,783,574.00	0.09
211	301136	招标股份	301,200	3,746,928.00	0.09
212	001201	东瑞股份	240,100	3,735,956.00	0.09
213	300176	鸿特科技	535,700	3,728,472.00	0.09
214	002022	科华生物	607,000	3,726,980.00	0.09
215	000955	欣龙控股	785,800	3,693,260.00	0.09
216	301072	中捷精工	171,100	3,673,517.00	0.08
217	300928	华安鑫创	109,800	3,672,810.00	0.08

218	000705	浙江震元	434,300	3,669,835.00	0.08
219	002494	华斯股份	720,900	3,669,381.00	0.08
220	002285	世联行	1,608,700	3,667,836.00	0.08
221	002972	科安达	297,400	3,655,046.00	0.08
222	000593	德龙汇能	601,300	3,619,826.00	0.08
223	603778	国晟科技	1,076,900	3,618,384.00	0.08
224	300187	永清环保	709,300	3,617,430.00	0.08
225	603421	鼎信通讯	533,800	3,592,474.00	0.08
226	002524	光正眼科	797,300	3,587,850.00	0.08
227	000626	远大控股	528,500	3,583,230.00	0.08
228	300425	中建环能	683,700	3,582,588.00	0.08
229	000090	天健集团	1,008,600	3,570,444.00	0.08
230	603113	金能科技	514,200	3,563,406.00	0.08
231	002777	久远银海	194,900	3,558,874.00	0.08
232	600741	华域汽车	201,200	3,551,180.00	0.08
233	002863	今飞凯达	700,400	3,551,028.00	0.08
234	600076	康欣新材	1,492,000	3,550,960.00	0.08
235	002702	海欣食品	842,400	3,521,232.00	0.08
236	300869	康泰医学	245,300	3,517,602.00	0.08
237	300247	融捷健康	900,400	3,511,560.00	0.08
238	600271	航天信息	378,100	3,493,644.00	0.08
239	300270	中威电子	443,500	3,485,910.00	0.08
240	301326	捷邦科技	43,700	3,484,638.00	0.08
241	601388	怡球资源	1,381,800	3,482,136.00	0.08
242	000421	南京公用	529,700	3,480,129.00	0.08
243	601886	江河集团	565,800	3,479,670.00	0.08
244	000153	丰原药业	563,360	3,475,931.20	0.08
245	002367	康力电梯	493,400	3,468,602.00	0.08
246	000036	华联控股	949,060	3,464,069.00	0.08
247	002671	龙泉股份	751,400	3,456,440.00	0.08
248	301232	飞沃科技	112,400	3,454,052.00	0.08
249	600078	澄星股份	608,200	3,448,494.00	0.08
250	600386	北巴传媒	754,100	3,446,237.00	0.08
251	300448	浩云科技	508,000	3,444,240.00	0.08
252	601311	骆驼股份	380,600	3,436,818.00	0.08
253	300737	科顺股份	712,600	3,434,732.00	0.08
254	002451	摩恩电气	495,500	3,433,815.00	0.08
255	603051	鹿山新材	120,500	3,431,840.00	0.08
256	300833	浩洋股份	102,500	3,426,575.00	0.08
257	300423	昇辉科技	476,900	3,357,376.00	0.08
258	603700	宁水集团	276,400	3,311,272.00	0.08
259	300597	吉大通信	335,808	3,270,769.92	0.08
260	603208	江山欧派	206,500	3,237,920.00	0.07

261	300978	东箭科技	289,200	3,227,472.00	0.07
262	300937	药易购	112,200	3,206,676.00	0.07
263	300126	锐奇股份	439,100	3,187,866.00	0.07
264	600626	申达股份	877,100	3,183,873.00	0.07
265	600008	首创环保	1,053,200	3,180,664.00	0.07
266	301172	君逸数码	154,020	3,180,513.00	0.07
267	300639	凯普生物	547,600	3,176,080.00	0.07
268	300374	中铁装配	199,600	3,173,640.00	0.07
269	601999	出版传媒	453,600	3,170,664.00	0.07
270	001239	永达股份	212,200	3,170,268.00	0.07
271	000068	华控赛格	925,800	3,166,236.00	0.07
272	300393	中来股份	548,800	3,161,088.00	0.07
273	600261	阳光照明	963,200	3,159,296.00	0.07
274	605258	协和电子	101,200	3,152,380.00	0.07
275	600159	大龙地产	1,145,600	3,150,400.00	0.07
276	002330	得利斯	685,800	3,140,964.00	0.07
277	000635	英力特	354,000	3,139,980.00	0.07
278	300086	康芝药业	577,700	3,136,911.00	0.07
279	002787	华源控股	383,800	3,135,646.00	0.07
280	002186	全聚德	296,199	3,133,785.42	0.07
281	300062	中能电气	582,200	3,132,236.00	0.07
282	002135	东南网架	741,300	3,128,286.00	0.07
283	600692	亚通股份	434,000	3,124,800.00	0.07
284	301159	三维天地	93,000	3,120,150.00	0.07
285	002110	三钢闽光	888,400	3,118,284.00	0.07
286	002531	天顺风能	436,700	3,118,038.00	0.07
287	300692	中环环保	466,450	3,115,886.00	0.07
288	600785	新华百货	265,400	3,113,142.00	0.07
289	002218	拓日新能	958,700	3,106,188.00	0.07
290	000546	金圆股份	624,600	3,104,262.00	0.07
291	001205	盛航股份	190,700	3,098,875.00	0.07
292	600195	中牧股份	421,400	3,088,862.00	0.07
293	002491	通鼎互联	543,300	3,085,944.00	0.07
294	300628	亿联网络	88,600	3,079,736.00	0.07
295	600749	西藏旅游	259,100	3,075,517.00	0.07
296	002788	鹭燕医药	358,000	3,068,060.00	0.07
297	000301	东方盛虹	368,100	3,066,273.00	0.07
298	000498	山东路桥	520,100	3,058,188.00	0.07
299	600675	中华企业	1,059,500	3,051,360.00	0.07
300	002228	合兴包装	842,392	2,973,643.76	0.07
301	300786	国林科技	191,700	2,973,267.00	0.07
302	603682	锦和商管	521,900	2,959,173.00	0.07
303	600713	南京医药	584,700	2,958,582.00	0.07

304	002551	尚荣医疗	782,200	2,941,072.00	0.07
305	000782	恒申新材	585,800	2,934,858.00	0.07
306	002661	克明食品	290,700	2,909,907.00	0.07
307	603444	吉比特	9,500	2,868,525.00	0.07
308	300826	测绘股份	167,200	2,862,464.00	0.07
309	603633	徕木股份	329,200	2,860,748.00	0.07
310	600135	乐凯胶片	369,000	2,848,680.00	0.07
311	300500	启迪设计	233,600	2,838,240.00	0.07
312	301378	通达海	95,900	2,831,927.00	0.07
313	600768	宁波富邦	247,600	2,830,068.00	0.07
314	605068	明新旭腾	157,200	2,824,884.00	0.07
315	301365	矩阵股份	164,800	2,824,672.00	0.07
316	301321	翰博高新	184,600	2,822,534.00	0.07
317	002368	太极股份	120,400	2,819,768.00	0.06
318	003020	立方制药	125,900	2,810,088.00	0.06
319	300407	凯发电气	265,600	2,807,392.00	0.06
320	300535	达威股份	168,900	2,802,051.00	0.06
321	301633	港迪技术	38,500	2,800,875.00	0.06
322	300594	朗进科技	153,800	2,799,160.00	0.06
323	002054	德美化工	406,700	2,798,096.00	0.06
324	003005	竞业达	138,260	2,794,234.60	0.06
325	002694	顾地科技	571,300	2,793,657.00	0.06
326	600099	林海股份	257,700	2,793,468.00	0.06
327	688711	宏微科技	158,763	2,792,641.17	0.06
328	300800	力合科技	251,400	2,788,026.00	0.06
329	002696	百洋股份	459,300	2,787,951.00	0.06
330	603527	众源新材	256,100	2,783,807.00	0.06
331	603207	小方制药	95,900	2,778,223.00	0.06
332	603968	醋化股份	244,300	2,777,691.00	0.06
333	603987	康德莱	360,700	2,777,390.00	0.06
334	301198	喜悦智行	248,000	2,775,120.00	0.06
335	300334	津膜科技	403,500	2,772,045.00	0.06
336	600984	建设机械	860,400	2,761,884.00	0.06
337	688651	盛邦安全	80,815	2,758,215.95	0.06
338	603126	中材节能	445,400	2,757,026.00	0.06
339	301503	智迪科技	72,400	2,754,820.00	0.06
340	001266	宏英智能	104,100	2,753,445.00	0.06
341	600097	开创国际	263,400	2,749,896.00	0.06
342	000720	新能泰山	787,800	2,749,422.00	0.06
343	600728	佳都科技	504,100	2,747,345.00	0.06
344	688819	天能股份	98,950	2,746,852.00	0.06
345	000411	英特集团	256,120	2,745,606.40	0.06
346	000698	沈阳化工	720,500	2,745,105.00	0.06

347	002758	浙农股份	307,100	2,742,403.00	0.06
348	000703	恒逸石化	465,700	2,738,316.00	0.06
349	002234	民和股份	335,900	2,737,585.00	0.06
350	002495	佳隆股份	1,060,300	2,735,574.00	0.06
351	002486	嘉麟杰	1,043,600	2,734,232.00	0.06
352	002328	新朋股份	469,600	2,733,072.00	0.06
353	001210	金房能源	199,268	2,727,978.92	0.06
354	600802	福建水泥	586,200	2,725,830.00	0.06
355	300445	康斯特	159,800	2,724,590.00	0.06
356	001379	腾达科技	131,300	2,720,536.00	0.06
357	603183	建研院	641,500	2,719,960.00	0.06
358	000798	中水渔业	366,496	2,719,400.32	0.06
359	000911	广农糖业	373,700	2,716,799.00	0.06
360	002877	智能自控	310,300	2,715,125.00	0.06
361	000686	东北证券	354,500	2,704,835.00	0.06
362	600683	京投发展	702,300	2,703,855.00	0.06
363	600716	凤凰股份	730,400	2,702,480.00	0.06
364	002016	世荣兆业	493,000	2,701,640.00	0.06
365	002375	亚厦股份	699,800	2,694,230.00	0.06
366	002120	韵达股份	401,500	2,690,050.00	0.06
367	002059	云南旅游	513,200	2,684,036.00	0.06
368	002349	精华制药	372,200	2,676,118.00	0.06
369	600433	冠豪高新	870,400	2,672,128.00	0.06
370	601003	柳钢股份	759,100	2,672,032.00	0.06
371	003037	三和管桩	371,900	2,670,242.00	0.06
372	002888	惠威科技	147,200	2,670,208.00	0.06
373	001366	播恩集团	218,400	2,666,664.00	0.06
374	603385	惠达卫浴	400,800	2,661,312.00	0.06
375	603628	清源股份	217,200	2,652,012.00	0.06
376	603759	海天股份	311,200	2,642,088.00	0.06
377	301111	粤万年青	164,800	2,605,488.00	0.06
378	600477	杭萧钢构	982,738	2,604,255.70	0.06
379	002679	福建金森	270,800	2,586,140.00	0.06
380	002069	獐子岛	647,600	2,512,688.00	0.06
381	603933	睿能科技	143,800	2,476,236.00	0.06
382	603316	诚邦股份	274,600	2,468,654.00	0.06
383	002623	亚玛顿	152,700	2,466,105.00	0.06
384	301631	壹连科技	29,800	2,461,480.00	0.06
385	001387	雪祺电气	178,100	2,447,094.00	0.06
386	603808	歌力思	294,500	2,444,350.00	0.06
387	001336	楚环科技	114,300	2,431,161.00	0.06
388	300970	华绿生物	167,400	2,427,300.00	0.06
389	603030	全筑股份	879,000	2,426,040.00	0.06

390	688509	正元地信	565,397	2,425,553.13	0.06
391	002652	扬子新材	734,400	2,423,520.00	0.06
392	688038	中科通达	151,589	2,405,717.43	0.06
393	603860	中公高科	77,200	2,402,464.00	0.06
394	300371	汇中股份	207,000	2,401,200.00	0.06
395	002114	罗平锌电	338,900	2,399,412.00	0.06
396	603669	灵康药业	444,100	2,398,140.00	0.06
397	002910	庄园牧场	254,300	2,395,506.00	0.06
398	300929	华骐环保	226,800	2,395,008.00	0.06
399	300670	大烨智能	363,700	2,393,146.00	0.06
400	605186	健麾信息	114,200	2,391,348.00	0.06
401	002813	路畅科技	100,400	2,388,516.00	0.06
402	001373	翔腾新材	79,400	2,385,176.00	0.05
403	603105	芯能科技	289,900	2,382,978.00	0.05
404	603903	中持股份	305,100	2,382,831.00	0.05
405	002883	中设股份	211,200	2,382,336.00	0.05
406	300550	和仁科技	175,000	2,378,250.00	0.05
407	605177	东亚药业	128,700	2,377,089.00	0.05
408	603617	君禾股份	331,400	2,376,138.00	0.05
409	603098	森特股份	233,100	2,375,289.00	0.05
410	600791	京能置业	501,900	2,373,987.00	0.05
411	300675	建科院	160,300	2,372,440.00	0.05
412	002672	东江环保	520,600	2,368,730.00	0.05
413	300141	和顺电气	258,300	2,368,611.00	0.05
414	605001	威奥股份	328,500	2,361,915.00	0.05
415	688098	申联生物	386,465	2,361,301.15	0.05
416	603289	泰瑞机器	247,400	2,355,248.00	0.05
417	301313	凡拓数创	96,900	2,354,670.00	0.05
418	300710	万隆光电	118,300	2,351,804.00	0.05
419	002394	联发股份	285,600	2,350,488.00	0.05
420	600168	武汉控股	505,100	2,348,715.00	0.05
421	603558	健盛集团	257,800	2,348,558.00	0.05
422	301046	能辉科技	118,300	2,348,255.00	0.05
423	603773	沃格光电	95,300	2,348,192.00	0.05
424	600665	天地源	700,800	2,347,680.00	0.05
425	600382	广东明珠	429,900	2,342,955.00	0.05
426	688109	品茗科技	75,031	2,335,715.03	0.05
427	000548	湖南投资	437,300	2,335,182.00	0.05
428	301189	奥尼电子	88,600	2,331,066.00	0.05
429	600526	菲达环保	485,100	2,328,480.00	0.05
430	688529	豪森智能	129,633	2,325,616.02	0.05
431	600369	西南证券	532,400	2,315,940.00	0.05
432	600229	城市传媒	324,700	2,315,111.00	0.05

433	600516	方大炭素	498,740	2,314,153.60	0.05
434	605259	绿田机械	117,840	2,310,842.40	0.05
435	301180	万祥科技	156,800	2,309,664.00	0.05
436	000404	长虹华意	325,200	2,308,920.00	0.05
437	603817	海峡环保	396,200	2,305,884.00	0.05
438	600356	恒丰纸业	286,200	2,303,910.00	0.05
439	301151	冠龙节能	132,000	2,303,400.00	0.05
440	600235	民丰特纸	368,400	2,302,500.00	0.05
441	002282	博深股份	308,000	2,300,760.00	0.05
442	688597	煜邦电力	293,712	2,299,764.96	0.05
443	603858	步长制药	141,600	2,299,584.00	0.05
444	002975	博杰股份	66,900	2,286,642.00	0.05
445	000553	安道麦 A	316,300	2,283,686.00	0.05
446	000789	万年青	416,500	2,274,090.00	0.05
447	002532	天山铝业	273,600	2,273,616.00	0.05
448	000702	正虹科技	314,600	2,271,412.00	0.05
449	000011	深物业 A	268,700	2,270,515.00	0.05
450	301516	中远通	134,500	2,246,150.00	0.05
451	300461	田中精机	111,000	2,236,650.00	0.05
452	002363	隆基机械	293,200	2,231,252.00	0.05
453	300292	吴通控股	455,800	2,219,746.00	0.05
454	300011	鼎汉技术	296,120	2,212,016.40	0.05
455	300977	深圳瑞捷	121,550	2,197,624.00	0.05
456	000717	中南股份	897,400	2,189,656.00	0.05
457	603618	杭电股份	356,000	2,171,600.00	0.05
458	300707	威唐工业	156,400	2,159,884.00	0.05
459	300559	佳发教育	182,200	2,149,960.00	0.05
460	605180	华生科技	145,000	2,146,000.00	0.05
461	603601	再升科技	521,500	2,117,290.00	0.05
462	002869	金溢科技	88,050	2,107,036.50	0.05
463	301010	晶雪节能	122,100	2,090,352.00	0.05
464	301170	锡南科技	77,600	2,077,352.00	0.05
465	688296	和达科技	157,728	2,070,968.64	0.05
466	300107	建新股份	257,900	2,065,779.00	0.05
467	600847	万里股份	186,800	2,054,800.00	0.05
468	002918	蒙娜丽莎	246,200	2,043,460.00	0.05
469	300931	通用电梯	267,700	2,042,551.00	0.05
470	300385	雪浪环境	381,660	2,041,881.00	0.05
471	600815	厦工股份	742,800	2,027,844.00	0.05
472	301348	蓝箭电子	86,100	2,025,933.00	0.05
473	002963	豪尔赛	159,400	2,022,786.00	0.05
474	301062	上海艾录	233,300	2,015,712.00	0.05
475	600748	上实发展	651,300	2,012,517.00	0.05

476	301173	毓恬冠佳	43,300	2,006,089.00	0.05
477	000597	东北制药	388,200	2,003,112.00	0.05
478	002876	三利谱	79,500	2,002,605.00	0.05
479	301106	骏成科技	67,100	1,999,580.00	0.05
480	301528	多浦乐	37,100	1,996,722.00	0.05
481	300162	雷曼光电	262,500	1,995,000.00	0.05
482	603177	德创环保	218,900	1,991,990.00	0.05
483	301469	恒达新材	75,100	1,991,652.00	0.05
484	301100	风光股份	114,300	1,991,106.00	0.05
485	300405	科隆股份	352,400	1,991,060.00	0.05
486	300190	维尔利	570,307	1,990,371.43	0.05
487	600067	冠城新材	667,500	1,989,150.00	0.05
488	603122	合富中国	291,100	1,988,213.00	0.05
489	300843	胜蓝股份	62,700	1,986,963.00	0.05
490	301519	舜禹股份	144,600	1,986,804.00	0.05
491	301419	阿莱德	71,960	1,986,096.00	0.05
492	301049	超越科技	83,100	1,982,766.00	0.05
493	300877	金春股份	122,600	1,978,764.00	0.05
494	002333	罗普斯金	359,200	1,975,600.00	0.05
495	603898	好莱客	179,700	1,974,903.00	0.05
496	600469	风神股份	349,400	1,974,110.00	0.05
497	301133	金钟股份	87,000	1,973,160.00	0.05
498	600272	开开实业	144,300	1,968,252.00	0.05
499	301157	华塑科技	41,700	1,965,738.00	0.05
500	300358	楚天科技	251,800	1,964,040.00	0.05
501	002420	毅昌科技	313,800	1,958,112.00	0.05
502	300774	倍杰特	223,600	1,956,500.00	0.05
503	603081	大丰实业	180,200	1,949,764.00	0.04
504	001231	农心科技	96,700	1,945,604.00	0.04
505	603172	万丰股份	121,800	1,940,274.00	0.04
506	600719	大连热电	299,000	1,937,520.00	0.04
507	605222	起帆电缆	127,700	1,933,378.00	0.04
508	600616	金枫酒业	340,700	1,928,362.00	0.04
509	002390	信邦制药	553,000	1,924,440.00	0.04
510	300388	节能国祯	276,300	1,923,048.00	0.04
511	000156	华数传媒	242,000	1,921,480.00	0.04
512	002852	道道全	200,900	1,920,604.00	0.04
513	002398	垒知集团	388,700	1,920,178.00	0.04
514	600966	博汇纸业	433,400	1,915,628.00	0.04
515	300289	利德曼	368,300	1,915,160.00	0.04
516	000919	金陵药业	280,100	1,907,481.00	0.04
517	600488	津药药业	455,500	1,899,435.00	0.04
518	300656	民德电子	70,900	1,895,157.00	0.04

519	301388	欣灵电气	76,600	1,885,126.00	0.04
520	000089	深圳机场	270,900	1,869,210.00	0.04
521	301512	智信精密	44,300	1,867,688.00	0.04
522	002905	金逸影视	200,600	1,861,568.00	0.04
523	301221	光庭信息	35,800	1,860,526.00	0.04
524	600681	百川能源	521,600	1,830,816.00	0.04
525	603176	汇通集团	376,200	1,805,760.00	0.04
526	002613	北玻股份	488,300	1,801,827.00	0.04
527	603191	望变电气	140,900	1,778,158.00	0.04
528	301387	光大同创	45,600	1,773,840.00	0.04
529	301539	宏鑫科技	95,200	1,763,104.00	0.04
530	688280	精进电动	242,423	1,762,415.21	0.04
531	688367	工大高科	99,735	1,760,322.75	0.04
532	300813	泰林生物	79,200	1,695,672.00	0.04
533	688078	龙软科技	53,024	1,680,860.80	0.04
534	603058	永吉股份	192,000	1,678,080.00	0.04
535	605162	新中港	222,700	1,672,477.00	0.04
536	605567	春雪食品	162,600	1,663,398.00	0.04
537	003016	欣贺股份	218,700	1,640,250.00	0.04
538	603528	多伦科技	194,000	1,617,960.00	0.04
539	300948	冠中生态	148,400	1,616,076.00	0.04
540	301552	科力装备	41,520	1,609,315.20	0.04
541	688323	瑞华泰	110,827	1,608,099.77	0.04
542	301045	天禄科技	70,100	1,605,290.00	0.04
543	002587	奥拓电子	248,700	1,604,115.00	0.04
544	301314	科瑞思	39,900	1,603,581.00	0.04
545	301446	福事特	68,100	1,603,074.00	0.04
546	688737	中自科技	74,506	1,601,879.00	0.04
547	603936	博敏电子	169,600	1,599,328.00	0.04
548	300235	方直科技	145,100	1,597,551.00	0.04
549	001255	博菲电气	49,500	1,597,365.00	0.04
550	600615	丰华股份	142,800	1,593,648.00	0.04
551	600038	中直股份	41,000	1,591,210.00	0.04
552	002893	京能热力	148,800	1,590,672.00	0.04
553	002858	力盛体育	119,100	1,586,412.00	0.04
554	300981	中红医疗	132,380	1,584,588.60	0.04
555	301278	快可电子	47,500	1,583,175.00	0.04
556	001211	双枪科技	69,400	1,583,014.00	0.04
557	603709	中源家居	120,900	1,578,954.00	0.04
558	301356	天振股份	88,700	1,577,973.00	0.04
559	300805	电声股份	143,400	1,577,400.00	0.04
560	300508	维宏股份	55,500	1,575,645.00	0.04
561	603201	常润股份	85,300	1,573,785.00	0.04

562	002718	友邦吊顶	99,300	1,572,912.00	0.04
563	301618	长联科技	26,320	1,572,620.00	0.04
564	301598	博科测试	25,500	1,572,075.00	0.04
565	002614	奥佳华	240,300	1,571,562.00	0.04
566	300668	杰恩设计	90,300	1,568,511.00	0.04
567	300335	迪森股份	287,200	1,568,112.00	0.04
568	600838	上海九百	193,700	1,567,033.00	0.04
569	002935	天奥电子	97,900	1,566,400.00	0.04
570	603348	文灿股份	74,900	1,563,912.00	0.04
571	601366	利群股份	339,400	1,561,240.00	0.04
572	603309	维力医疗	122,390	1,556,800.80	0.04
573	301390	经纬股份	43,100	1,556,772.00	0.04
574	301386	未来电器	71,600	1,555,868.00	0.04
575	300491	通合科技	81,400	1,554,740.00	0.04
576	301222	浙江恒威	53,400	1,554,474.00	0.04
577	000812	陕西金叶	331,300	1,553,797.00	0.04
578	603168	莎普爱思	210,100	1,552,639.00	0.04
579	300715	凯伦股份	156,600	1,551,906.00	0.04
580	001218	丽臣实业	84,960	1,550,520.00	0.04
581	300295	三六五网	96,400	1,550,112.00	0.04
582	000910	大亚圣象	204,800	1,548,288.00	0.04
583	301295	美硕科技	64,800	1,546,128.00	0.04
584	600509	天富能源	239,700	1,546,065.00	0.04
585	000726	鲁泰 A	243,700	1,545,058.00	0.04
586	300110	华仁药业	478,000	1,543,940.00	0.04
587	603568	伟明环保	80,900	1,543,572.00	0.04
588	603886	元祖股份	117,900	1,540,953.00	0.04
589	600533	栖霞建设	610,900	1,539,468.00	0.04
590	000552	甘肃能化	623,200	1,539,304.00	0.04
591	301501	恒鑫生活	31,300	1,538,708.00	0.04
592	301418	协昌科技	42,100	1,538,334.00	0.04
593	002256	兆新股份	654,400	1,537,840.00	0.04
594	301370	国科恒泰	144,300	1,536,795.00	0.04
595	002810	山东赫达	128,500	1,535,575.00	0.04
596	301115	联检科技	99,000	1,533,510.00	0.04
597	000898	鞍钢股份	660,700	1,532,824.00	0.04
598	002726	龙大美食	262,900	1,530,078.00	0.04
599	601368	绿城水务	314,800	1,526,780.00	0.04
600	301036	双乐股份	40,800	1,526,736.00	0.04
601	603976	正川股份	83,800	1,525,998.00	0.04
602	603156	养元饮品	72,100	1,525,636.00	0.04
603	000049	德赛电池	67,001	1,524,942.76	0.04
604	000529	广弘控股	248,441	1,517,974.51	0.03

605	603661	恒林股份	53,000	1,515,800.00	0.03
606	688065	凯赛生物	31,720	1,494,012.00	0.03
607	600819	耀皮玻璃	248,601	1,446,857.82	0.03
608	301163	宏德股份	56,000	1,400,000.00	0.03
609	301202	朗威股份	33,500	1,376,850.00	0.03
610	600496	精工钢构	417,900	1,337,280.00	0.03
611	300891	惠云钛业	138,400	1,331,408.00	0.03
612	002830	名雕股份	86,900	1,324,356.00	0.03
613	000936	华西股份	190,100	1,307,888.00	0.03
614	600654	中安科	437,300	1,298,781.00	0.03
615	000895	双汇发展	53,200	1,298,612.00	0.03
616	300897	山科智能	60,940	1,279,740.00	0.03
617	002799	环球印务	147,000	1,267,140.00	0.03
618	301585	蓝宇股份	36,680	1,258,124.00	0.03
619	300933	中辰股份	165,600	1,256,904.00	0.03
620	300983	尤安设计	64,000	1,249,280.00	0.03
621	688681	科汇股份	88,621	1,240,694.00	0.03
622	605399	晨光新材	95,400	1,219,212.00	0.03
623	301361	众智科技	39,800	1,215,094.00	0.03
624	002903	宇环数控	62,000	1,214,580.00	0.03
625	300512	中亚股份	140,900	1,208,922.00	0.03
626	603602	纵横通信	79,100	1,206,275.00	0.03
627	301515	港通医疗	59,300	1,205,569.00	0.03
628	603458	勘设股份	151,500	1,198,365.00	0.03
629	688558	国盛智科	47,347	1,195,038.28	0.03
630	600512	腾达建设	527,700	1,192,602.00	0.03
631	300736	百邦科技	111,900	1,185,021.00	0.03
632	301105	鸿铭股份	31,900	1,184,447.00	0.03
633	603311	金海高科	107,000	1,183,420.00	0.03
634	300906	日月明	43,000	1,182,500.00	0.03
635	600774	汉商集团	139,400	1,182,112.00	0.03
636	300935	盈建科	47,800	1,180,660.00	0.03
637	605366	宏柏新材	188,600	1,180,636.00	0.03
638	605168	三人行	40,100	1,180,143.00	0.03
639	003011	海象新材	64,200	1,179,354.00	0.03
640	688030	山石网科	73,608	1,176,991.92	0.03
641	605086	龙高股份	44,100	1,173,942.00	0.03
642	300739	明阳电路	79,100	1,173,844.00	0.03
643	600376	首开股份	478,800	1,173,060.00	0.03
644	301102	兆讯传媒	107,400	1,172,808.00	0.03
645	002535	林州重机	293,700	1,171,863.00	0.03
646	603012	创力集团	211,900	1,171,807.00	0.03
647	001376	百通能源	95,700	1,171,368.00	0.03

648	003008	开普检测	55,100	1,170,875.00	0.03
649	301166	优宁维	38,257	1,170,281.63	0.03
650	600620	天宸股份	214,200	1,169,532.00	0.03
651	600230	沧州大化	110,900	1,167,777.00	0.03
652	603095	越剑智能	71,040	1,167,187.20	0.03
653	002687	乔治白	251,500	1,166,960.00	0.03
654	000551	创元科技	90,800	1,166,780.00	0.03
655	002841	视源股份	33,700	1,166,020.00	0.03
656	002084	海鸥住工	328,300	1,165,465.00	0.03
657	600117	西宁特钢	520,278	1,165,422.72	0.03
658	300540	蜀道装备	70,960	1,165,163.20	0.03
659	603182	嘉华股份	87,400	1,162,420.00	0.03
660	688667	菱电电控	21,767	1,158,222.07	0.03
661	001226	拓山重工	41,600	1,158,144.00	0.03
662	002732	燕塘乳业	70,300	1,157,841.00	0.03
663	300103	达刚控股	170,000	1,157,700.00	0.03
664	603916	苏博特	127,600	1,156,056.00	0.03
665	002884	凌霄泵业	72,500	1,155,650.00	0.03
666	688429	时创能源	79,417	1,154,723.18	0.03
667	000897	津滨发展	502,000	1,154,600.00	0.03
668	002566	益盛药业	148,000	1,154,400.00	0.03
669	600075	新疆天业	272,323	1,151,926.29	0.03
670	600630	龙头股份	140,400	1,151,280.00	0.03
671	688153	唯捷创芯	37,095	1,150,315.95	0.03
672	600058	五矿发展	148,700	1,149,451.00	0.03
673	603718	海利生物	154,000	1,145,760.00	0.03
674	600963	岳阳林纸	258,100	1,143,383.00	0.03
675	001259	利仁科技	44,700	1,141,638.00	0.03
676	603396	金辰股份	43,200	1,101,600.00	0.03
677	301355	南王科技	87,200	1,041,168.00	0.02
678	688557	兰剑智能	33,619	1,006,216.67	0.02
679	603282	亚光股份	58,800	1,001,364.00	0.02
680	301129	瑞纳智能	34,700	942,452.00	0.02
681	300057	万顺新材	153,600	837,120.00	0.02
682	603001	奥康国际	121,400	825,520.00	0.02
683	600052	东望时代	178,900	822,940.00	0.02
684	688565	力源科技	87,941	813,454.25	0.02
685	688485	九州一轨	74,481	811,098.09	0.02
686	603115	海星股份	56,100	809,523.00	0.02
687	688335	复洁环保	66,032	805,590.40	0.02
688	300154	瑞凌股份	89,100	801,900.00	0.02
689	300912	凯龙高科	54,400	799,136.00	0.02
690	301161	唯万密封	35,200	798,688.00	0.02

691	603488	展鹏科技	96,700	797,775.00	0.02
692	688121	卓然股份	65,729	794,006.32	0.02
693	300549	优德精密	43,400	793,786.00	0.02
694	301252	同星科技	31,800	792,774.00	0.02
695	688056	莱伯泰科	23,747	792,674.86	0.02
696	603909	建发合诚	81,300	791,862.00	0.02
697	002442	龙星科技	124,100	791,758.00	0.02
698	001225	和泰机电	22,700	790,414.00	0.02
699	300642	透景生命	53,600	788,992.00	0.02
700	002942	新农股份	45,300	787,314.00	0.02
701	688223	晶科能源	151,613	786,871.47	0.02
702	301332	德尔玛	76,800	786,432.00	0.02
703	001326	联域股份	23,100	786,324.00	0.02
704	300329	海伦钢琴	103,600	785,288.00	0.02
705	301456	盘古智能	32,100	785,166.00	0.02
706	605007	五洲特纸	68,200	784,982.00	0.02
707	603230	内蒙新华	60,700	783,637.00	0.02
708	001229	魅视科技	23,800	783,496.00	0.02
709	688585	上纬新材	100,683	783,313.74	0.02
710	001360	南矿集团	56,200	782,304.00	0.02
711	000537	中绿电	93,200	779,152.00	0.02
712	002871	伟隆股份	70,000	779,100.00	0.02
713	301360	荣旗科技	16,200	778,572.00	0.02
714	600330	天通股份	108,200	775,794.00	0.02
715	002198	嘉应制药	126,000	774,900.00	0.02
716	605266	健之佳	36,800	773,904.00	0.02
717	300712	永福股份	32,200	773,766.00	0.02
718	601700	风范股份	165,100	771,017.00	0.02
719	600689	上海三毛	63,100	769,820.00	0.02
720	002493	荣盛石化	92,800	768,384.00	0.02
721	603180	金牌家居	39,400	767,118.00	0.02
722	600935	华塑股份	316,700	766,414.00	0.02
723	605500	森林包装	103,672	766,136.08	0.02
724	603895	天永智能	29,500	765,525.00	0.02
725	301337	亚华电子	26,200	765,302.00	0.02
726	688370	丛麟科技	39,978	763,979.58	0.02
727	002595	豪迈科技	12,900	763,938.00	0.02
728	603989	艾华集团	47,900	737,660.00	0.02
729	603878	武进不锈	134,900	731,158.00	0.02
730	603070	万控智造	53,700	713,673.00	0.02
731	001300	三柏硕	46,500	630,075.00	0.01
732	600502	安徽建工	115,200	541,440.00	0.01
733	600742	富维股份	44,894	426,941.94	0.01

734	688419	耐科装备	10,745	400,573.60	0.01
735	300305	裕兴股份	62,500	398,750.00	0.01
736	688092	爱科科技	17,802	396,984.60	0.01
737	301097	天益医疗	9,900	395,901.00	0.01
738	688285	高铁电气	48,042	393,944.40	0.01
739	301578	辰奕智能	11,000	393,690.00	0.01
740	603380	易德龙	14,800	393,680.00	0.01
741	300958	建工修复	29,800	392,466.00	0.01
742	688307	中润光学	13,769	391,590.36	0.01
743	688695	中创股份	13,164	390,970.80	0.01
744	300606	金太阳	19,800	390,456.00	0.01
745	688517	金冠电气	27,128	390,100.64	0.01
746	300939	秋田微	12,800	389,120.00	0.01
747	301020	密封科技	17,800	388,574.00	0.01
748	300234	开尔新材	78,000	387,660.00	0.01
748	600661	昂立教育	36,400	387,660.00	0.01
749	000531	穗恒运 A	63,000	387,450.00	0.01
750	605365	立达信	26,300	387,399.00	0.01
751	688125	安达智能	10,531	386,487.70	0.01
752	688317	之江生物	21,445	386,438.90	0.01
753	300279	和晶科技	55,700	386,001.00	0.01
754	600690	海尔智家	15,500	384,090.00	0.01
755	300625	三雄极光	32,300	384,047.00	0.01
756	000650	仁和药业	70,800	383,736.00	0.01
757	603303	得邦照明	31,700	382,619.00	0.01
758	301296	新巨丰	39,800	382,478.00	0.01
759	603856	东宏股份	33,200	380,140.00	0.01
760	688579	山大地纬	33,887	379,195.53	0.01
761	605089	味知香	15,136	375,978.24	0.01
762	603609	禾丰股份	45,500	375,830.00	0.01
763	002021	中捷资源	137,500	317,625.00	0.01
764	600998	九州通	27,500	141,350.00	0.00
765	603022	新通联	10,900	120,554.00	0.00
766	600483	福能股份	10,130	97,653.20	0.00
767	000927	中国铁物	16,900	43,433.00	0.00
768	000883	湖北能源	4,400	19,844.00	0.00
769	000836	ST 富通	994,600	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	300033	同花顺	157,939,386.19	4.85

2	002384	东山精密	143,951,242.00	4.42
3	600941	中国移动	128,642,716.65	3.95
4	000651	格力电器	117,041,910.03	3.59
5	301236	软通动力	110,304,329.00	3.39
6	601162	天风证券	105,614,867.00	3.24
7	688008	澜起科技	98,961,613.28	3.04
8	600919	江苏银行	91,655,862.74	2.81
9	600839	四川长虹	91,495,003.84	2.81
10	601689	拓普集团	83,336,480.77	2.56
11	603799	华友钴业	82,871,838.61	2.54
12	601668	中国建筑	81,529,797.46	2.50
13	600938	中国海油	81,103,967.00	2.49
14	600926	杭州银行	79,019,807.62	2.43
15	688220	翱捷科技	76,827,900.69	2.36
16	600096	云天化	76,362,771.00	2.34
17	600795	国电电力	76,151,414.00	2.34
18	002463	沪电股份	74,262,062.78	2.28
19	000338	潍柴动力	72,891,020.00	2.24
20	601225	陕西煤业	72,309,489.72	2.22
21	601009	南京银行	69,906,426.60	2.15

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	600919	江苏银行	141,288,647.87	4.34
2	002384	东山精密	107,394,409.41	3.30
3	000651	格力电器	105,783,030.77	3.25
4	600839	四川长虹	98,682,493.11	3.03
5	300033	同花顺	97,208,521.20	2.98
6	601689	拓普集团	84,072,834.26	2.58
7	301236	软通动力	81,876,012.50	2.51
8	688220	翱捷科技	79,220,557.41	2.43
9	600941	中国移动	78,060,276.21	2.40
10	601225	陕西煤业	74,760,295.20	2.29
11	300570	太辰光	72,447,382.18	2.22
12	601009	南京银行	72,322,231.86	2.22
13	601006	大秦铁路	70,745,235.88	2.17
14	002600	领益智造	62,907,078.00	1.93
15	600570	恒生电子	61,359,162.64	1.88
16	000977	浪潮信息	59,917,484.98	1.84
17	600887	伊利股份	56,619,346.48	1.74
18	300672	国科微	55,998,063.74	1.72

19	000333	美的集团	55,025,806.00	1.69
20	601939	建设银行	52,519,854.16	1.61

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	12,016,705,687.26
卖出股票收入（成交）总额	11,613,098,512.26

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	1,086,995.44
2	应收清算款	41,383,774.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,065,159.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,535,928.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国金量化多因子 A	106,923	8,441.53	192,546,358.26	21.33	710,047,311.26	78.67
国金量化多因子 C	49,460	18,019.63	555,074,309.21	62.28	336,176,796.60	37.72
合计	156,383	11,470.84	747,620,667.47	41.68	1,046,224,107.86	58.32

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	4,321,630.36	0.4788
	国金量化多因子 C	307,578.71	0.0345
	合计	4,629,209.07	0.2581

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	1,177,839,970.30	433,713,441.73
本报告期基金总申购份额	286,098,869.67	765,507,149.45
减：本报告期基金总赎回份额	561,345,170.45	307,969,485.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	902,593,669.52	891,251,105.81

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，聘任边济东先生为资产托管部总经理。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，基金托管人的专门基金托管部门无其他重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及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

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

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 (%)	
长江证券	2	2,169,796.2	9.18	967,516.89	9.18	-

		35.82				
广发证券	2	2,151,197,139.98	9.10	959,225.53	9.10	-
东北证券	1	2,051,924,506.05	8.68	914,959.81	8.68	-
华泰证券	2	1,848,208,582.19	7.82	824,119.58	7.82	-
国海证券	2	1,815,363,555.90	7.68	809,467.63	7.68	-
西南证券	1	1,608,367,096.15	6.81	717,176.36	6.81	-
中信建投 证券	2	1,547,950,670.57	6.55	690,233.49	6.55	-
浙商证券	1	1,533,909,643.67	6.49	683,968.23	6.49	-
东吴证券	1	1,436,553,675.33	6.08	640,559.91	6.08	-
天风证券	1	1,383,126,827.23	5.85	616,732.98	5.85	-
中信证券	2	1,306,729,498.44	5.53	582,670.91	5.53	-
国联民生 证券	1	1,259,666,038.02	5.33	561,673.42	5.33	-
华创证券	1	992,506,519.93	4.20	442,559.37	4.20	-
光大证券	1	609,448,087.48	2.58	271,755.00	2.58	-
兴业证券	1	539,347,025.02	2.28	240,490.40	2.28	-
招商证券	2	531,060,854.88	2.25	236,801.80	2.25	-
国信证券	1	362,328,390.59	1.53	161,563.50	1.53	-
华安证券	1	353,764,312.64	1.50	157,746.46	1.50	-
国投证券	1	128,555,539.63	0.54	57,323.48	0.54	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

国泰海通 证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	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国海证券、财通证券、东吴证券共 3 个交易单元，减少英大证券共 1 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	成交金额	占当期债券 回购成交总	成交金额	占当期权 证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
长江证 券	-	-	1,267,281,00 0.00	10.35	-	-
广发证 券	-	-	1,128,685,00 0.00	9.22	-	-
东北证 券	-	-	965,349,000. 00	7.89	-	-
华泰证 券	-	-	1,027,190,00 0.00	8.39	-	-
国海证 券	-	-	1,097,200,00 0.00	8.96	-	-
西南证 券	-	-	854,048,000. 00	6.98	-	-
中信建 投证券	-	-	544,800,000. 00	4.45	-	-
浙商证 券	-	-	715,400,000. 00	5.84	-	-
东吴证 券	-	-	762,200,000. 00	6.23	-	-
天风证 券	-	-	668,300,000. 00	5.46	-	-
中信证 券	-	-	673,119,000. 00	5.50	-	-
国联民 生证券	-	-	731,600,000. 00	5.98	-	-
华创证 券	-	-	396,843,000. 00	3.24	-	-
光大证 券	-	-	424,899,000. 00	3.47	-	-
兴业证 券	-	-	182,400,000. 00	1.49	-	-
招商证 券	-	-	306,439,000. 00	2.50	-	-
国信证 券	-	-	266,439,000. 00	2.18	-	-
华安证 券	-	-	147,200,000. 00	1.20	-	-
国投证 券	-	-	80,411,000.0 0	0.66	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
财通证	-	-	-	-	-	-

券						
民生证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 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	2025 年 1 月 17 日
2	《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	2025 年 1 月 17 日

3	《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	2025 年 1 月 17 日
4	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日
5	《国金基金管理有限公司关于关闭微信交易平台的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 2 月 7 日
6	《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	2025 年 2 月 20 日
7	《国金基金管理有限公司关于终止厦门市鑫鼎盛控股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	2025 年 3 月 11 日
8	《关于国金基金管理公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 20 日
9	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2024 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
10	《国金基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 31 日
11	《国金基金管理有限公司关于运用公司自有资金和高级管理人员自有资金投资旗下权益基金的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 4 月 14 日
12	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
13	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 25 日
14	《关于对单个基金账户国金量化多因子股票型证券投资基金限制大额申购、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	2025 年 6 月 18 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

2025 年 8 月 30 日