

国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	11
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内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53

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	53
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§ 9	开放式基金份额变动	56
§ 10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8	其他重大事件	58
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金智享量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	国金智享量化选股混合	
基金主代码	018823	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 22 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,387,101,869.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	018823	018824
报告期末下属分级基金的份额总额	605,958,079.30 份	781,143,790.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过量化方法综合考虑标的中长期的表现，优选具有超额收益的个股构建投资组合，力求为基金份额持有人获取持续稳定的超越业绩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：股票投资策略、存托凭证投资策略、固定收益品种投资策略、衍生品投资策略。</p> <p>股票投资策略部分，本基金“自上而下”构建选股模型，在风险模型约束下，紧密跟踪基准，严格控制运作风险，并根据各个子模型一定时期内的表现情况对其迭代，提高整体模型的适应能力，目标取得持续稳定的超额收益。本基金将依据经济基本面、市场情绪等相对基础的数据出发，构建模型选取中中长期具有超额收益的个股构成股票投资组合。选股模型不仅从盈利和营业收入等角度评估上市公司的价值和成长性，同时充分考虑市场情绪等因素为标的合理定价。</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	中证 800 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静	罗琦
	联系电话	010-88005695	020-66338888

电子邮箱	zhangjing@gfund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话	4000-2000-18	95575
传真	010-88005666	020-87553363-6847
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
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	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码	100020	510627
法定代表人	邵海波	林传辉

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办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
本期已实现收益	-91,271,193.89	-118,158,983.49
本期利润	-74,899,433.33	-103,516,000.02
加权平均基金份额 本期利润	-0.1099	-0.1172
本期加权平均净 值利润率	-12.69%	-13.57%
本期基金份额净 值增长率	-11.15%	-11.36%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-99,836,730.46	-131,498,420.09

期末可供分配基金份额利润	-0.1648	-0.1683
期末基金资产净值	506,121,348.84	649,645,370.15
期末基金份额净值	0.8352	0.8317
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-16.48%	-16.83%

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

国金智享量化选股混合 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	-2.65%	0.71%	-3.20%	0.45%	0.55%	0.26%
过去三个月	-4.69%	0.80%	-2.22%	0.66%	-2.47%	0.14%
过去六个月	-11.15%	1.27%	-0.47%	0.82%	-10.68%	0.45%
自基金合同生效起至今	-16.48%	1.09%	-6.00%	0.75%	-10.48%	0.34%

国金智享量化选股混合 C

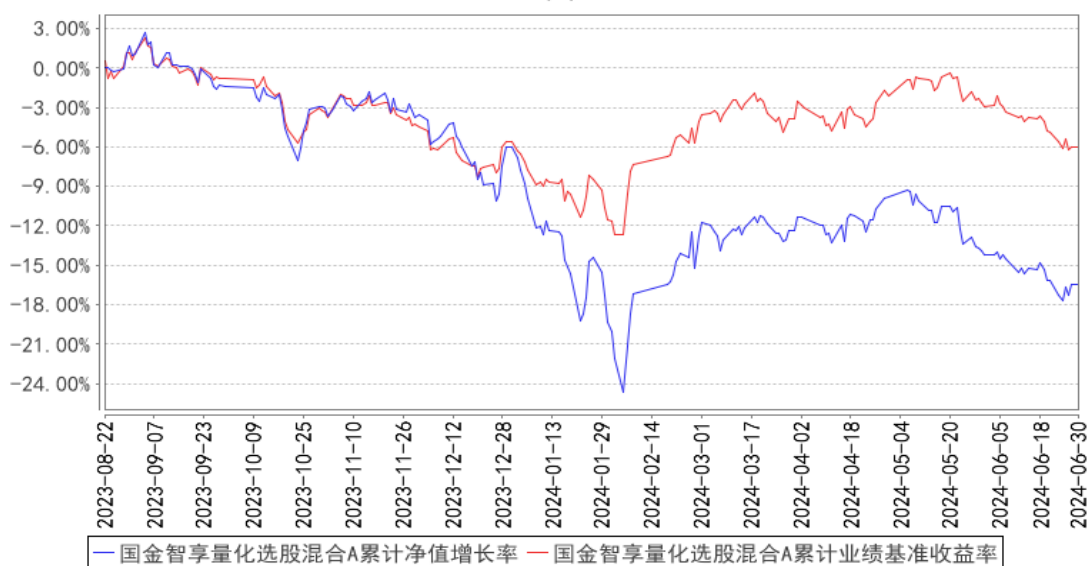
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.68%	0.71%	-3.20%	0.45%	0.52%	0.26%
过去三个月	-4.80%	0.80%	-2.22%	0.66%	-2.58%	0.14%

过去六个月	-11.36%	1.27%	-0.47%	0.82%	-	10.89%	0.45%
自基金合同生效起至今	-16.83%	1.09%	-6.00%	0.75%	-	10.83%	0.34%

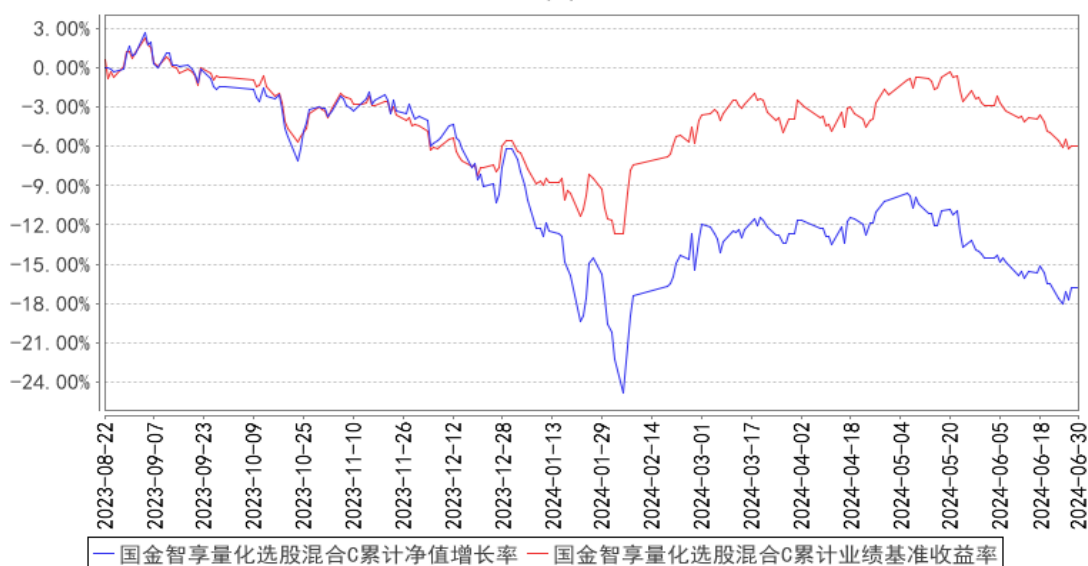
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

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

国金智享量化选股混合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



国金智享量化选股混合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：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2023 年 8 月 22 日至 2024 年 2 月 21 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661 号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2024 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 26 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

马芳	本基金的基金经理	2023 年 8 月 22 日	-	8 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资中心副总经理。
----	----------	-----------------	---	-----	---

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。

4.2 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《国金智享量化选股混合型证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 6 次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

本基金今年部分区间相对波动较大，与同期市场环境的特征有一定关系。随着风险模型的优化，中长期观测力争降低相对收益波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 0.8352 元，累计单位净值为 0.8352 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-11.15%，同期业绩比较基准增长率为-0.47%。

本基金 C 类份额单位净值为 0.8317 元，累计单位净值为 0.8317 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-11.36%，同期业绩比较基准增长率为-0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金

融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国金智享量化选股混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，国金基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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

本基金托管人依法对国金基金管理有限公司编制和披露的国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：国金智享量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
货币资金	6.4.7.1	95,288,939.45	133,677,132.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,064,604,867.05	1,557,580,752.38
其中：股票投资		1,064,604,867.05	1,557,580,752.38
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	-	-345.30
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		54,120.38	748,728.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,159,947,926.88	1,692,006,268.00
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2024年6月30日	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,414,884.61	4,906,695.01
应付管理人报酬		1,176,129.31	1,772,950.49
应付托管费		196,021.55	295,491.76
应付销售服务费		275,738.49	418,525.20
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	118,433.93	100,063.34
负债合计		4,181,207.89	7,493,725.80

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,387,101,869.54	1,793,786,490.66
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-231,335,150.55	-109,273,948.46
净资产合计		1,155,766,718.99	1,684,512,542.20
负债和净资产总计		1,159,947,926.88	1,692,006,268.00

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国金智享量化选股混合 A 基金份额净值 0.8352 元，基金份额总额 605,958,079.30 份；国金智享量化选股混合 C 基金份额净值 0.8317 元，基金份额总额 781,143,790.24 份。国金智享量化选股混合份额总额合计为 1,387,101,869.54 份。

6.2 利润表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-166,986,091.19
1. 利息收入		269,779.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	236,872.94
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		32,906.24
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-198,915,892.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-208,059,548.07
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	9,143,655.13
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	31,014,744.03
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	645,278.54
减：二、营业总支出		11,429,342.16

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,080,743.97
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,346,790.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,897,381.50
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	104,426.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-178,415,433.35
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-178,415,433.35
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-178,415,433.35

6.3 净资产变动表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,793,786,490. 66	-	- 109,273,948.46	1,684,512,542.2 0
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,793,786,490. 66	-	- 109,273,948.46	1,684,512,542.2 0
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 406,684,621.12	-	- 122,061,202.09	-528,745,823.21
（一）、综合收益总额	-	-	- 178,415,433.35	-178,415,433.35
（二）、本期基金	-	-	56,354,231.26	-350,330,389.86

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	406,684,621.12			
其中：1. 基金申购款	96,066,928.72	-	-14,759,029.28	81,307,899.44
2. 基金赎回款	- 502,751,549.84	-	71,113,260.54	-431,638,289.30
(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	1,387,101,869. 54	-	- 231,335,150.55	1,155,766,718.9 9

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：

郇海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金智享量化选股混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1358号文《关于准予国金智享量化选股混合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2023年8月22日正式生效，本基金首次募集规模为1,992,048,014.27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，基金托管人为广发证券股份有限公司。

本基金主要投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、次级债、

可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须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。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例范围为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化

个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,901,231.69
等于：本金	1,899,491.20
加：应计利息	1,740.49
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	93,387,707.76
等于：本金	93,377,851.80
加：应计利息	9,855.96
减：坏账准备	-
合计	95,288,939.45

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,094,438,729.88	-	1,064,604,867.05	-29,833,862.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,094,438,729.88	-	1,064,604,867.05	-29,833,862.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,185.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
其他	11,822.44
合计	118,433.93

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金智享量化选股混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	780,456,800.53	780,456,800.53
本期申购	48,001,244.90	48,001,244.90
本期赎回（以“-”号填列）	-222,499,966.13	-222,499,966.13
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	605,958,079.30	605,958,079.30

国金智享量化选股混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,013,329,690.13	1,013,329,690.13
本期申购	48,065,683.82	48,065,683.82
本期赎回（以“-”号填列）	-280,251,583.71	-280,251,583.71
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	781,143,790.24	781,143,790.24

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

6.4.7.11 其他综合收益

注：无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金智享量化选股混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22,879,659.72	-23,919,502.63	-46,799,162.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-22,879,659.72	-23,919,502.63	-46,799,162.35
本期利润	-91,271,193.89	16,371,760.56	-74,899,433.33
本期基金份额交易产生的变动数	20,373,079.13	1,488,786.09	21,861,865.22
其中：基金申购款	-5,286,400.61	-4,018,591.23	-9,304,991.84
基金赎回款	25,659,479.74	5,507,377.32	31,166,857.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-93,777,774.48	-6,058,955.98	-99,836,730.46

国金智享量化选股混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-31,438,043.57	-31,036,742.54	-62,474,786.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-31,438,043.57	-31,036,742.54	-62,474,786.11
本期利润	-118,158,983.49	14,642,983.47	-103,516,000.02
本期基金份额交易产生的变动数	25,930,257.24	8,562,108.80	34,492,366.04
其中：基金申购款	-3,756,232.23	-1,697,805.21	-5,454,037.44
基金赎回款	29,686,489.47	10,259,914.01	39,946,403.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-123,666,769.82	-7,831,650.27	-131,498,420.09

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	63,563.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	173,309.66
结算备付金利息收入	-

其他	-
合计	236,872.94

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-208,059,548.07
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	-208,059,548.07

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	9,069,441,245.03
减：卖出股票成本总额	9,262,571,136.44
减：交易费用	14,929,656.66
买卖股票差价收入	-208,059,548.07

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,143,655.13
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	9,143,655.13

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	31,014,744.03
股票投资	31,014,744.03
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	31,014,744.03

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	402,584.99
基金转换费收入	242,693.55
合计	645,278.54

6.4.7.22 信用减值损失

注：无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	104,426.14

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	17,808,021,752.11	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	388,091,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	9,253,365.10	100.00	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,080,743.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,968,605.78
应支付基金管理人的净管理费	4,112,138.19

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。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 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	1,346,790.55

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

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金智享量化选股混 合 A	国金智享量化选股混 合 C	合计
国金基金管理有限公司	-	3,167.49	3,167.49
国金证券股份有限公司	-	41.66	41.66
广发证券股份有限公司	-	1,783,207.22	1,783,207.22
合计	-	1,786,416.37	1,786,416.37

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 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无

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

注：无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司-活期存款	1,901,231.69	63,563.28
广发证券股份有限公司-其他存款	93,387,707.76	173,309.66

注：1. 本基金的其他存款为存放在开立于基金结算机构证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2. 除其他存款外，本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2024年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	95,288,939.45	-	-	-	-	-	95,288,939.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,064,604,867.05	1,064,604,867.05
应收申购款	-	-	-	-	-	54,120.38	54,120.38

资产总计	95,288,939.45	-	-	-	-	-1,064,658,987.43	1,159,947,926.88
负债							
应付赎回款						2,414,884.61	2,414,884.61
应付管理人报酬						1,176,129.31	1,176,129.31
应付托管费						196,021.55	196,021.55
应付销售服务费						275,738.49	275,738.49
其他负债						118,433.93	118,433.93
负债总计						4,181,207.89	4,181,207.89
利率敏感度缺口	95,288,939.45					-1,060,477,779.54	1,155,766,718.99
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	133,677,132.52						133,677,132.52
交易性金融资产						-1,557,580,752.38	1,557,580,752.38
买入返售金融资产	-345.30						-345.30
应收申购款						748,728.40	748,728.40
资产总计	133,676,787.22					-1,558,329,480.78	1,692,006,268.00
负债							
应付赎回款						4,906,695.01	4,906,695.01
应付管理人报酬						1,772,950.49	1,772,950.49
应付托管费						295,491.76	295,491.76
应付销售服务费						418,525.20	418,525.20
其他负债						100,063.34	100,063.34
负债总计						7,493,725.80	7,493,725.80
利率敏感度缺口	133,676,787.22					-1,550,835,754.98	1,684,512,542.20

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,064,604,867.05	92.11	1,557,580,752.38	92.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,064,604,867.05	92.11	1,557,580,752.38	92.46

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 800 指数（000906.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 800 指数数据回归得出，反映了基金和中证 800 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6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	+5%	62,073,891.92	72,194,939.97
-5%	-62,073,891.92	-72,194,939.97	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,064,604,867.05	1,557,580,752.38
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,064,604,867.05	1,557,580,752.38

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,064,604,867.05	91.78
	其中：股票	1,064,604,867.05	91.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	95,288,939.45	8.21
8	其他各项资产	54,120.38	0.00
9	合计	1,159,947,926.88	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	682,682.00	0.06
B	采矿业	37,421,458.18	3.24
C	制造业	744,728,344.21	64.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,458,567.00	2.29
E	建筑业	52,382,436.00	4.53
F	批发和零售业	5,969,051.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	26,064,035.00	2.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,443,189.11	8.69
J	金融业	54,766,128.38	4.74
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	2,515,712.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	2,384,397.72	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	4,595,501.45	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,063,515.00	0.18
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,129,850.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	1,064,604,867.05	92.11

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603501	韦尔股份	319,940	31,792,437.80	2.75
2	601728	中国电信	4,755,200	29,244,480.00	2.53
3	600690	海尔智家	1,012,700	28,740,426.00	2.49
4	601668	中国建筑	4,919,600	26,123,076.00	2.26
5	600019	宝钢股份	3,828,100	25,456,865.00	2.20
6	600050	中国联通	5,398,100	25,371,070.00	2.20
7	600900	长江电力	873,600	25,264,512.00	2.19
8	000651	格力电器	597,200	23,422,184.00	2.03
9	000725	京东方 A	5,629,900	23,026,291.00	1.99
10	600887	伊利股份	859,655	22,213,485.20	1.92
11	000333	美的集团	338,900	21,859,050.00	1.89
12	601800	中国交建	2,351,700	21,024,198.00	1.82
13	600183	生益科技	928,500	19,554,210.00	1.69
14	601601	中国太保	689,328	19,204,678.08	1.66
15	000063	中兴通讯	681,600	19,064,352.00	1.65
16	601766	中国中车	2,464,000	18,504,640.00	1.60
17	600018	上港集团	3,175,600	18,354,968.00	1.59
18	600989	宝丰能源	1,054,200	18,269,286.00	1.58
19	600188	兖矿能源	774,066	17,594,520.18	1.52
20	605499	东鹏饮料	79,500	17,152,125.00	1.48
21	601633	长城汽车	663,100	16,776,430.00	1.45
22	600346	恒力石化	1,195,600	16,678,620.00	1.44
23	000338	潍柴动力	981,400	15,937,936.00	1.38
24	601127	赛力斯	174,700	15,918,664.00	1.38
25	601600	中国铝业	2,079,000	15,862,770.00	1.37
26	601012	隆基绿能	1,098,700	15,403,774.00	1.33

27	002236	大华股份	927,000	14,331,420.00	1.24
28	002371	北方华创	44,200	14,139,138.00	1.22
29	300750	宁德时代	75,960	13,675,078.80	1.18
30	601898	中煤能源	1,013,500	12,648,480.00	1.09
31	601169	北京银行	2,134,600	12,466,064.00	1.08
32	002415	海康威视	374,000	11,560,340.00	1.00
33	601865	福莱特	567,500	11,406,750.00	0.99
34	600362	江西铜业	428,600	10,149,248.00	0.88
35	601989	中国重工	1,807,200	8,909,496.00	0.77
36	601229	上海银行	1,123,800	8,158,788.00	0.71
37	002601	龙佰集团	423,500	7,864,395.00	0.68
38	601877	正泰电器	377,500	7,195,150.00	0.62
39	600377	宁沪高速	531,200	6,693,120.00	0.58
40	600707	彩虹股份	963,900	6,564,159.00	0.57
41	300408	三环集团	222,100	6,483,099.00	0.56
42	600893	航发动力	165,600	6,052,680.00	0.52
43	600703	三安光电	511,800	5,998,296.00	0.52
44	601336	新华保险	193,200	5,801,796.00	0.50
45	600941	中国移动	51,900	5,579,250.00	0.48
46	688187	时代电气	108,481	5,356,791.78	0.46
47	688819	天能股份	222,560	5,310,281.60	0.46
48	600985	淮北矿业	309,700	5,184,378.00	0.45
49	688036	传音控股	59,152	4,527,494.08	0.39
50	603260	合盛硅业	93,500	4,367,385.00	0.38
51	600372	中航机载	348,700	4,173,939.00	0.36
52	000066	中国长城	460,900	4,032,875.00	0.35
53	300433	蓝思科技	220,800	4,029,600.00	0.35
54	000708	中信特钢	292,000	3,962,440.00	0.34
55	603893	瑞芯微	66,000	3,905,220.00	0.34
56	301052	果麦文化	190,000	3,895,000.00	0.34
57	300628	亿联网络	100,700	3,702,739.00	0.32
58	600999	招商证券	258,290	3,592,813.90	0.31
59	002625	光启技术	198,100	3,437,035.00	0.30
60	600219	南山铝业	834,100	3,177,921.00	0.27
61	601319	中国人保	557,800	2,872,670.00	0.25
62	600398	海澜之家	287,900	2,660,196.00	0.23
63	603918	金桥信息	247,800	2,589,510.00	0.22
64	688588	凌志软件	367,689	2,518,669.65	0.22
65	601567	三星医疗	64,200	2,247,000.00	0.19
66	600582	天地科技	315,300	2,172,417.00	0.19
67	600776	东方通信	218,300	2,145,889.00	0.19
68	301185	鸥玛软件	147,700	2,116,541.00	0.18
69	603160	汇顶科技	29,200	2,007,500.00	0.17

70	600968	海油发展	484,000	1,994,080.00	0.17
71	000157	中联重科	244,800	1,880,064.00	0.16
72	301169	零点有数	65,200	1,877,760.00	0.16
73	300088	长信科技	384,100	1,805,270.00	0.16
74	688080	映翰通	58,096	1,762,051.68	0.15
75	603527	众源新材	248,000	1,760,800.00	0.15
76	600476	湘邮科技	146,700	1,760,400.00	0.15
77	300652	雷迪克	86,800	1,721,244.00	0.15
78	300279	和晶科技	397,100	1,655,907.00	0.14
79	688365	光云科技	268,659	1,617,327.18	0.14
80	300782	卓胜微	20,600	1,601,444.00	0.14
81	002347	泰尔股份	416,600	1,570,582.00	0.14
82	603089	正裕工业	187,500	1,567,500.00	0.14
83	301159	三维天地	57,000	1,520,190.00	0.13
84	300611	美力科技	198,800	1,514,856.00	0.13
85	688028	沃尔德	88,877	1,460,249.11	0.13
86	300235	方直科技	177,800	1,425,956.00	0.12
87	301298	东利机械	111,000	1,415,250.00	0.12
88	300379	东方通	173,300	1,400,264.00	0.12
89	300112	万讯自控	202,700	1,398,630.00	0.12
90	603121	华培动力	194,100	1,381,992.00	0.12
91	601216	君正集团	374,500	1,381,905.00	0.12
92	688292	浩瀚深度	88,432	1,367,158.72	0.12
93	300694	蠡湖股份	155,400	1,322,454.00	0.11
94	605208	永茂泰	210,030	1,308,486.90	0.11
95	600130	波导股份	409,800	1,307,262.00	0.11
96	601218	吉鑫科技	467,500	1,304,325.00	0.11
97	603681	永冠新材	100,400	1,280,100.00	0.11
98	300414	中光防雷	192,100	1,269,781.00	0.11
99	300095	华伍股份	229,900	1,266,749.00	0.11
100	603269	海鸥股份	127,700	1,254,014.00	0.11
101	600498	烽火通信	78,000	1,240,200.00	0.11
102	300605	恒锋信息	134,900	1,222,194.00	0.11
103	600177	雅戈尔	167,176	1,190,293.12	0.10
104	300535	达威股份	100,100	1,181,180.00	0.10
105	002931	锋龙股份	114,300	1,164,717.00	0.10
106	002212	天融信	237,900	1,158,573.00	0.10
107	688071	华依科技	53,137	1,151,478.79	0.10
108	300665	飞鹿股份	225,500	1,143,285.00	0.10
109	300420	五洋自控	518,900	1,136,391.00	0.10
110	300473	德尔股份	83,300	1,133,713.00	0.10
111	000703	恒逸石化	159,700	1,132,273.00	0.10
112	300508	维宏股份	57,600	1,119,168.00	0.10

113	603829	洛凯股份	94,400	1,116,752.00	0.10
114	002185	华天科技	136,200	1,110,030.00	0.10
115	603110	东方材料	99,700	1,109,661.00	0.10
116	002998	优彩资源	193,800	1,098,846.00	0.10
117	301066	万事利	134,800	1,091,880.00	0.09
118	301380	挖金客	33,700	1,079,748.00	0.09
119	300707	威唐工业	87,100	1,078,298.00	0.09
120	300883	龙利得	250,800	1,060,884.00	0.09
121	603118	共进股份	158,200	1,059,940.00	0.09
122	600960	渤海汽车	396,200	1,053,892.00	0.09
123	688509	正元地信	360,648	1,042,272.72	0.09
124	603982	泉峰汽车	130,000	1,040,000.00	0.09
125	605136	丽人丽妆	186,700	1,028,717.00	0.09
126	688078	龙软科技	44,338	1,021,104.14	0.09
127	002414	高德红外	172,100	1,013,669.00	0.09
128	603321	梅轮电梯	148,300	1,012,889.00	0.09
129	002576	通达动力	89,100	1,011,285.00	0.09
130	601616	广电电气	339,300	987,363.00	0.09
131	688681	科汇股份	96,078	980,956.38	0.08
132	603161	科华控股	64,900	971,553.00	0.08
133	002745	木林森	120,300	969,618.00	0.08
134	688316	青云科技	31,930	955,026.30	0.08
135	301040	中环海陆	95,800	949,378.00	0.08
136	603656	泰禾智能	87,400	949,164.00	0.08
137	002354	天娱数科	313,300	936,767.00	0.08
138	601998	中信银行	139,800	936,660.00	0.08
139	603926	铁流股份	112,600	934,580.00	0.08
140	605066	天正电气	167,000	930,190.00	0.08
141	301003	江苏博云	42,950	923,854.50	0.08
142	301056	森赫股份	119,400	915,798.00	0.08
143	600386	北巴传媒	327,400	913,446.00	0.08
144	603928	兴业股份	115,020	900,606.60	0.08
145	688733	壹石通	60,101	898,509.95	0.08
146	688369	致远互联	56,926	895,445.98	0.08
147	002164	宁波东力	232,800	893,952.00	0.08
148	603328	依顿电子	113,600	892,896.00	0.08
149	603177	德创环保	126,700	890,701.00	0.08
150	603022	新通联	122,100	888,888.00	0.08
151	603048	浙江黎明	60,900	884,268.00	0.08
152	688168	安博通	32,772	881,566.80	0.08
153	600299	安迪苏	90,800	880,760.00	0.08
154	301197	工大科雅	66,900	877,728.00	0.08
155	002402	和而泰	81,900	877,149.00	0.08

156	600562	国睿科技	64,000	874,240.00	0.08
157	301032	新柴股份	129,800	870,958.00	0.08
158	300230	永利股份	258,800	869,568.00	0.08
159	603041	美思德	85,600	856,000.00	0.07
160	600455	博通股份	58,100	855,232.00	0.07
161	603683	晶华新材	107,000	849,580.00	0.07
162	603887	城地香江	162,700	847,667.00	0.07
163	603080	新疆火炬	62,800	845,288.00	0.07
164	300509	新美星	180,400	844,272.00	0.07
165	603051	鹿山新材	38,400	838,272.00	0.07
166	603115	海星股份	80,300	835,120.00	0.07
167	301234	五洲医疗	38,500	833,525.00	0.07
168	300126	锐奇股份	183,100	829,443.00	0.07
169	002753	永东股份	142,600	828,506.00	0.07
170	300329	海伦钢琴	219,000	825,630.00	0.07
171	301075	多瑞医药	51,800	823,620.00	0.07
172	603917	合力科技	75,900	821,238.00	0.07
173	600235	民丰特纸	178,000	818,800.00	0.07
174	003003	天元股份	102,200	814,534.00	0.07
175	002139	拓邦股份	75,900	806,058.00	0.07
176	603333	尚纬股份	254,500	791,495.00	0.07
177	688360	德马科技	64,859	780,902.36	0.07
178	605398	新炬网络	38,000	778,620.00	0.07
179	603045	福达合金	78,000	774,540.00	0.07
180	002825	纳尔股份	124,200	773,766.00	0.07
181	600295	鄂尔多斯	78,000	773,760.00	0.07
182	603949	雪龙集团	68,000	765,680.00	0.07
183	002774	快意电梯	120,400	764,540.00	0.07
184	603937	丽岛新材	98,400	763,584.00	0.07
185	600970	中材国际	63,100	760,986.00	0.07
186	002337	赛象科技	197,900	752,020.00	0.07
187	603577	汇金通	106,900	741,886.00	0.06
188	603811	诚意药业	118,300	739,375.00	0.06
189	002084	海鸥住工	300,400	735,980.00	0.06
190	002743	富煌钢构	198,700	733,203.00	0.06
191	603429	集友股份	176,140	730,981.00	0.06
192	688669	聚石化学	64,411	729,132.52	0.06
193	688109	品茗科技	26,294	719,140.90	0.06
194	300303	聚飞光电	147,900	718,794.00	0.06
195	603150	万朗磁塑	28,700	718,648.00	0.06
196	301053	远信工业	35,800	714,568.00	0.06
197	688153	唯捷创芯	19,300	714,100.00	0.06
198	301300	远翔新材	32,500	712,075.00	0.06

199	605255	天普股份	59,200	711,584.00	0.06
200	688737	中自科技	43,838	710,175.60	0.06
201	603956	威派格	133,600	709,416.00	0.06
202	002809	红墙股份	98,900	709,113.00	0.06
203	300564	筑博设计	83,000	707,990.00	0.06
204	600099	林海股份	102,700	706,576.00	0.06
205	600282	南钢股份	141,200	703,176.00	0.06
206	600610	中毅达	174,900	696,102.00	0.06
207	603036	如通股份	65,300	695,445.00	0.06
208	600667	太极实业	120,100	685,771.00	0.06
209	600730	中国高科	171,700	685,083.00	0.06
210	603095	越剑智能	52,200	684,342.00	0.06
211	600540	新赛股份	200,200	682,682.00	0.06
212	300640	德艺文创	173,100	682,014.00	0.06
213	002913	奥士康	25,400	680,974.00	0.06
214	688172	燕东微	41,559	672,424.62	0.06
215	603038	华立股份	91,200	666,672.00	0.06
216	603677	奇精机械	56,900	662,885.00	0.06
217	000663	永安林业	156,600	656,154.00	0.06
218	002064	华峰化学	91,500	656,055.00	0.06
219	688171	纬德信息	43,267	652,466.36	0.06
220	601187	厦门银行	122,200	651,326.00	0.06
221	600249	两面针	175,300	643,351.00	0.06
222	001218	丽臣实业	42,900	642,213.00	0.06
223	300980	祥源新材	40,500	638,280.00	0.06
224	688026	洁特生物	64,019	637,629.24	0.06
225	688291	金橙子	37,006	637,243.32	0.06
226	603488	展鹏科技	93,700	637,160.00	0.06
227	603810	丰山集团	75,900	634,524.00	0.05
228	000810	创维数字	73,200	628,056.00	0.05
229	603798	康普顿	74,300	625,606.00	0.05
230	301396	宏景科技	31,800	620,418.00	0.05
231	605100	华丰股份	52,700	612,901.00	0.05
232	600015	华夏银行	95,621	611,974.40	0.05
233	600735	新华锦	159,400	610,502.00	0.05
234	603903	中持股份	87,000	609,870.00	0.05
235	603331	百达精工	67,100	608,597.00	0.05
236	300897	山科智能	32,900	606,676.00	0.05
237	301365	矩阵股份	54,900	603,351.00	0.05
238	300958	建工修复	56,200	597,406.00	0.05
239	300877	金春股份	55,100	597,284.00	0.05
240	601717	郑煤机	40,300	596,440.00	0.05
241	603336	宏辉果蔬	198,000	595,980.00	0.05

242	300412	迦南科技	206,200	593,856.00	0.05
243	603159	上海亚虹	57,000	593,370.00	0.05
244	688435	英方软件	23,759	593,024.64	0.05
245	000985	大庆华科	47,000	592,200.00	0.05
246	300123	亚光科技	126,900	588,816.00	0.05
247	300079	数码视讯	144,700	587,482.00	0.05
248	600243	青海华鼎	218,200	586,958.00	0.05
249	688189	南新制药	103,560	583,042.80	0.05
250	603700	宁水集团	61,600	577,808.00	0.05
251	605303	园林股份	86,000	576,200.00	0.05
252	300658	延江股份	135,800	573,076.00	0.05
253	688585	上纬新材	108,931	563,173.27	0.05
254	003036	泰坦股份	70,200	560,898.00	0.05
255	603790	雅运股份	58,300	559,680.00	0.05
256	002394	联发股份	90,300	556,248.00	0.05
257	603666	亿嘉和	35,200	555,456.00	0.05
258	605288	凯迪股份	17,800	551,088.00	0.05
259	600366	宁波韵升	105,200	549,144.00	0.05
260	688296	和达科技	56,448	548,674.56	0.05
261	600137	浪莎股份	45,900	544,833.00	0.05
262	603123	翠微股份	91,600	544,104.00	0.05
263	002369	卓翼科技	147,200	543,168.00	0.05
264	603655	朗博科技	36,500	540,930.00	0.05
265	002598	山东章鼓	72,600	538,692.00	0.05
266	603192	汇得科技	40,100	538,543.00	0.05
267	001202	炬申股份	47,400	537,042.00	0.05
268	003027	同兴环保	43,600	536,280.00	0.05
269	300022	吉峰科技	149,700	531,435.00	0.05
270	300382	斯莱克	89,900	531,309.00	0.05
271	600156	华升股份	170,700	530,877.00	0.05
272	603958	哈森股份	64,500	526,965.00	0.05
273	600232	金鹰股份	121,800	524,958.00	0.05
274	688081	兴图新科	59,562	524,145.60	0.05
275	002659	凯文教育	160,000	523,200.00	0.05
276	605336	帅丰电器	46,400	522,928.00	0.05
277	300838	浙江力诺	50,500	519,140.00	0.04
278	603335	迪生力	126,600	519,060.00	0.04
279	300767	震安科技	60,700	514,736.00	0.04
280	603329	上海雅仕	46,700	514,634.00	0.04
281	603385	惠达卫浴	93,500	513,315.00	0.04
282	300132	青松股份	147,300	512,604.00	0.04
283	600152	维科技术	106,500	511,200.00	0.04
284	603955	大千生态	58,800	505,680.00	0.04

285	603359	东珠生态	139,000	504,570.00	0.04
286	603212	赛伍技术	45,500	502,320.00	0.04
287	300334	津膜科技	107,300	502,164.00	0.04
288	605068	明新旭腾	37,900	499,522.00	0.04
289	603238	诺邦股份	49,800	496,008.00	0.04
290	301007	德迈仕	42,200	492,896.00	0.04
291	300183	东软载波	42,300	489,834.00	0.04
292	300591	万里马	156,900	489,528.00	0.04
293	002890	弘宇股份	60,850	488,017.00	0.04
294	603272	联翔股份	57,100	485,350.00	0.04
295	600319	亚星化学	146,000	483,260.00	0.04
296	603196	日播时尚	68,200	481,492.00	0.04
297	603330	天洋新材	100,500	481,395.00	0.04
298	603028	赛福天	85,100	479,113.00	0.04
299	605287	德才股份	38,000	478,420.00	0.04
300	600405	动力源	132,200	477,242.00	0.04
301	301290	东星医疗	23,900	475,849.00	0.04
302	603214	爱婴室	42,100	475,309.00	0.04
303	002649	博彦科技	59,700	475,212.00	0.04
304	300331	苏大维格	29,400	472,752.00	0.04
305	688395	正弦电气	33,100	471,675.00	0.04
306	688529	豪森智能	34,932	469,486.08	0.04
307	002817	黄山胶囊	87,900	469,386.00	0.04
308	688227	品高股份	38,616	467,639.76	0.04
309	300323	华灿光电	107,500	467,625.00	0.04
310	600768	宁波富邦	66,700	467,567.00	0.04
311	603637	镇海股份	76,600	467,260.00	0.04
312	600410	华胜天成	120,700	467,109.00	0.04
313	688051	佳华科技	28,059	465,218.22	0.04
314	600128	苏豪弘业	73,000	465,010.00	0.04
315	300955	嘉亨家化	36,400	461,188.00	0.04
316	605033	美邦股份	37,100	460,782.00	0.04
317	688096	京源环保	90,898	459,034.90	0.04
318	300642	透景生命	39,400	458,616.00	0.04
319	600539	狮头股份	125,100	455,364.00	0.04
320	688386	泛亚微透	16,214	454,964.84	0.04
321	300134	大富科技	66,600	454,212.00	0.04
322	301065	本立科技	28,400	451,560.00	0.04
323	601869	长飞光纤	18,500	450,105.00	0.04
324	688798	艾为电子	7,935	449,279.70	0.04
325	688379	华光新材	32,672	447,933.12	0.04
326	688095	福昕软件	9,747	446,510.07	0.04
327	600847	万里股份	70,300	446,405.00	0.04

328	603316	诚邦股份	123,200	444,752.00	0.04
329	605566	福莱蒾特	29,200	444,716.00	0.04
330	688158	优刻得	43,443	444,421.89	0.04
331	603378	亚士创能	87,800	444,268.00	0.04
332	300986	志特新材	65,500	443,435.00	0.04
333	688511	天微电子	20,337	442,736.49	0.04
334	603629	利通电子	23,900	441,194.00	0.04
335	002860	星帅尔	53,800	440,622.00	0.04
336	601908	京运通	174,100	440,473.00	0.04
337	600841	动力新科	133,000	436,240.00	0.04
338	600689	上海三毛	64,500	435,375.00	0.04
339	600606	绿地控股	321,800	434,430.00	0.04
340	603122	合富中国	85,100	433,159.00	0.04
341	300371	汇中股份	51,700	432,729.00	0.04
342	002453	华软科技	99,700	427,713.00	0.04
343	688098	申联生物	102,166	426,032.22	0.04
344	688393	安必平	27,740	425,254.20	0.04
345	600618	氯碱化工	48,100	422,318.00	0.04
346	002909	集泰股份	101,000	414,100.00	0.04
347	605122	四方新材	42,100	409,212.00	0.04
348	300440	运达科技	77,900	408,975.00	0.04
349	300166	东方国信	65,800	402,696.00	0.03
350	603989	艾华集团	28,600	402,116.00	0.03
351	688067	爱威科技	27,776	398,585.60	0.03
352	605189	富春染织	37,300	397,618.00	0.03
353	688237	超卓航科	19,576	392,498.80	0.03
354	603106	恒银科技	91,700	390,642.00	0.03
355	605589	圣泉集团	19,000	385,510.00	0.03
356	300296	利亚德	85,600	385,200.00	0.03
357	688257	新锐股份	24,864	381,165.12	0.03
358	688030	山石网科	36,440	380,798.00	0.03
359	002718	友邦吊顶	36,400	380,016.00	0.03
360	603176	汇通集团	100,900	376,357.00	0.03
361	300227	光韵达	68,400	374,148.00	0.03
362	300399	天利科技	42,200	370,938.00	0.03
363	688057	金达莱	37,354	366,442.74	0.03
364	300588	熙菱信息	47,200	365,328.00	0.03
365	605151	西上海	24,800	363,320.00	0.03
366	300504	天邑股份	29,800	363,262.00	0.03
367	688622	禾信仪器	22,610	361,760.00	0.03
368	003015	日久光电	39,500	358,660.00	0.03
369	688129	东来技术	28,609	357,326.41	0.03
370	688367	工大高科	29,275	357,155.00	0.03

371	000020	深华发 A	36,000	356,400.00	0.03
372	688215	瑞晟智能	15,080	355,737.20	0.03
373	300846	首都在线	37,900	354,744.00	0.03
374	688251	井松智能	19,102	354,724.14	0.03
375	300366	创意信息	48,600	351,864.00	0.03
376	002488	金固股份	80,100	351,639.00	0.03
377	605118	力鼎光电	23,600	351,404.00	0.03
378	603976	正川股份	24,900	351,339.00	0.03
379	002516	旷达科技	96,000	349,440.00	0.03
380	688323	瑞华泰	34,695	349,378.65	0.03
381	600770	综艺股份	152,300	348,767.00	0.03
382	002467	二六三	104,300	348,362.00	0.03
383	300168	万达信息	73,200	347,700.00	0.03
384	002549	凯美特气	68,000	347,480.00	0.03
385	688680	海优新材	12,088	347,409.12	0.03
386	688679	通源环境	49,843	346,907.28	0.03
387	300385	雪浪环境	102,700	346,099.00	0.03
388	600802	福建水泥	124,300	345,554.00	0.03
389	688178	万德斯	33,353	343,869.43	0.03
390	603818	曲美家居	123,200	343,728.00	0.03
391	688021	奥福环保	37,345	343,574.00	0.03
392	600561	江西长运	92,600	337,064.00	0.03
393	688613	奥精医疗	26,319	335,040.87	0.03
394	688479	友车科技	21,014	333,912.46	0.03
395	603086	先达股份	87,600	332,880.00	0.03
396	300599	雄塑科技	66,400	330,008.00	0.03
397	300148	天舟文化	141,900	327,789.00	0.03
398	002636	金安国纪	51,600	327,660.00	0.03
399	002449	国星光电	46,000	327,520.00	0.03
400	600423	柳化股份	141,400	326,634.00	0.03
401	603489	八方股份	12,000	323,760.00	0.03
402	603282	亚光股份	19,000	320,340.00	0.03
403	603626	科森科技	57,600	320,256.00	0.03
404	300992	泰福泵业	20,200	318,756.00	0.03
405	603819	神力股份	30,200	317,100.00	0.03
406	603037	凯众股份	24,094	312,981.06	0.03
407	000619	海螺新材	76,400	308,656.00	0.03
408	000626	远大控股	73,600	305,440.00	0.03
409	688055	龙腾光电	93,070	295,031.90	0.03
410	603585	苏利股份	30,200	294,752.00	0.03
411	601002	晋亿实业	101,200	293,480.00	0.03
412	688565	力源科技	60,949	285,850.81	0.02
413	601009	南京银行	27,200	282,608.00	0.02

414	002786	银宝山新	35,000	280,700.00	0.02
415	688056	莱伯泰科	12,600	279,216.00	0.02
416	600193	创兴资源	77,900	272,650.00	0.02
417	603113	金能科技	49,600	271,312.00	0.02
418	603225	新凤鸣	17,400	271,266.00	0.02
419	600051	宁波联合	51,100	269,297.00	0.02
420	605055	迎丰股份	65,400	266,178.00	0.02
421	002283	天润工业	61,500	263,835.00	0.02
422	300559	佳发教育	27,500	263,175.00	0.02
423	002093	国脉科技	42,800	259,796.00	0.02
424	002376	新北洋	47,900	258,181.00	0.02
425	002955	鸿合科技	11,000	257,180.00	0.02
426	603618	杭电股份	58,100	254,478.00	0.02
427	600797	浙大网新	54,500	252,335.00	0.02
428	300608	思特奇	28,000	251,440.00	0.02
429	300032	金龙机电	79,100	246,001.00	0.02
430	688560	明冠新材	22,808	242,905.20	0.02
431	002527	新时达	40,400	241,996.00	0.02
432	300248	新开普	37,100	240,779.00	0.02
433	688339	亿华通	8,010	240,139.80	0.02
434	300571	平治信息	11,400	238,716.00	0.02
435	688163	赛伦生物	19,594	237,871.16	0.02
436	603216	梦天家居	25,700	235,926.00	0.02
437	002689	远大智能	109,900	235,186.00	0.02
438	000678	襄阳轴承	62,500	235,000.00	0.02
439	603466	风语筑	27,500	234,850.00	0.02
440	002316	亚联发展	75,400	234,494.00	0.02
441	688528	秦川物联	29,337	234,402.63	0.02
442	603098	森特股份	29,600	232,656.00	0.02
443	002017	东信和平	27,800	231,574.00	0.02
444	300369	绿盟科技	45,200	230,972.00	0.02
445	300472	新元科技	51,700	229,031.00	0.02
446	300766	每日互动	23,100	228,459.00	0.02
447	603201	常润股份	9,400	227,480.00	0.02
448	300884	狄耐克	26,100	224,982.00	0.02
449	603839	安正时尚	50,700	221,559.00	0.02
450	603303	得邦照明	19,200	220,416.00	0.02
451	688718	唯赛勃	25,717	219,880.35	0.02
452	688229	博睿数据	8,528	219,340.16	0.02
453	002866	传艺科技	16,900	217,503.00	0.02
454	688113	联测科技	7,561	214,505.57	0.02
455	001225	和泰机电	7,700	213,367.00	0.02
456	688329	艾隆科技	14,126	209,912.36	0.02

457	301205	联特科技	3,300	207,075.00	0.02
458	688309	恒誉环保	17,240	206,707.60	0.02
459	605365	立达信	12,700	201,549.00	0.02
460	002194	武汉凡谷	24,300	195,615.00	0.02
461	000995	皇台酒业	24,900	193,224.00	0.02
462	688193	仁度生物	7,113	187,000.77	0.02
463	000712	锦龙股份	24,900	186,750.00	0.02
464	300176	派生科技	41,900	184,779.00	0.02
465	688335	复洁环保	22,549	183,774.35	0.02
466	300349	金卡智能	14,900	177,608.00	0.02
467	300679	电连技术	4,200	168,966.00	0.01
468	002645	华宏科技	26,400	167,904.00	0.01
469	002798	帝欧家居	49,500	161,370.00	0.01
470	688011	新光光电	10,404	157,620.60	0.01
471	688788	科思科技	6,774	157,495.50	0.01
472	002855	捷荣技术	7,300	153,446.00	0.01
473	688013	天臣医疗	10,149	150,611.16	0.01
474	001278	一彬科技	9,000	142,290.00	0.01
475	002474	榕基软件	32,600	142,136.00	0.01
476	605050	福然德	16,100	141,841.00	0.01
477	600615	丰华股份	16,500	139,590.00	0.01
478	002136	安纳达	14,700	133,182.00	0.01
479	603729	龙韵股份	9,300	123,318.00	0.01
480	002205	国统股份	19,600	122,892.00	0.01
481	300082	奥克股份	27,700	118,002.00	0.01
482	300768	迪普科技	9,900	117,315.00	0.01
483	600261	阳光照明	42,400	114,480.00	0.01
484	002416	爱施德	12,700	112,395.00	0.01
485	300387	富邦股份	18,400	110,216.00	0.01
486	603188	亚邦股份	47,300	106,898.00	0.01
487	000536	华映科技	51,500	104,030.00	0.01
488	002426	胜利精密	64,700	102,226.00	0.01
489	300741	华宝股份	6,600	100,584.00	0.01
490	300030	阳普医疗	26,600	98,952.00	0.01
491	603978	深圳新星	10,700	95,765.00	0.01
492	600850	电科数字	4,900	88,690.00	0.01
493	300771	智莱科技	9,400	82,626.00	0.01
494	688670	金迪克	6,721	79,173.38	0.01
495	605500	森林包装	12,000	73,800.00	0.01
496	600623	华谊集团	12,100	69,938.00	0.01
497	688345	博力威	3,421	57,780.69	0.00
498	002705	新宝股份	4,000	56,280.00	0.00
499	300190	维尔利	18,900	51,975.00	0.00

500	000016	深康佳 A	22,800	48,564.00	0.00
501	300085	银之杰	5,100	41,208.00	0.00
502	605555	德昌股份	2,100	39,081.00	0.00
503	002171	楚江新材	5,600	36,904.00	0.00
504	603586	金麒麟	2,400	35,424.00	0.00
505	603909	建发合诚	3,700	30,784.00	0.00
506	600493	凤竹纺织	6,900	30,015.00	0.00
507	688175	高凌信息	1,952	28,850.56	0.00
508	600202	哈空调	6,000	21,420.00	0.00
509	603538	美诺华	600	6,702.00	0.00
510	301318	维海德	200	5,494.00	0.00
511	002585	双星新材	900	4,464.00	0.00
512	600997	开滦股份	600	4,116.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	122,337,018.00	7.26
2	000333	美的集团	86,588,226.43	5.14
3	600887	伊利股份	76,296,586.75	4.53
4	000651	格力电器	75,985,092.72	4.51
5	300014	亿纬锂能	74,170,128.35	4.40
6	600036	招商银行	70,362,991.00	4.18
7	600519	贵州茅台	70,197,204.58	4.17
8	600183	生益科技	69,126,089.13	4.10
9	600900	长江电力	66,576,277.00	3.95
10	601877	正泰电器	64,477,088.14	3.83
11	002241	歌尔股份	61,902,730.00	3.67
12	603501	韦尔股份	61,284,666.74	3.64
13	600028	中国石化	60,721,898.00	3.60
14	601319	中国人保	59,596,245.00	3.54
15	601169	北京银行	59,554,774.48	3.54
16	600941	中国移动	58,236,988.87	3.46
17	000021	深科技	57,781,326.03	3.43
18	601006	大秦铁路	57,308,747.00	3.40
19	600460	士兰微	57,284,240.00	3.40
20	601601	中国太保	57,099,475.12	3.39
21	601898	中煤能源	55,646,063.00	3.30
22	601288	农业银行	55,312,905.00	3.28
23	601211	国泰君安	54,783,074.00	3.25
24	600745	闻泰科技	54,683,121.00	3.25
25	601328	交通银行	54,080,065.00	3.21

26	000338	潍柴动力	53,813,281.00	3.19
27	600588	用友网络	53,730,615.00	3.19
28	003816	中国广核	53,502,917.80	3.18
29	601398	工商银行	52,923,930.00	3.14
30	603160	汇顶科技	51,598,836.08	3.06
31	601728	中国电信	51,553,634.00	3.06
32	601688	华泰证券	51,048,847.90	3.03
33	601818	光大银行	50,819,753.00	3.02
34	002410	广联达	48,150,070.20	2.86
35	601229	上海银行	47,820,071.23	2.84
36	600104	上汽集团	46,918,048.00	2.79
37	600100	同方股份	46,738,094.22	2.77
38	601658	邮储银行	45,450,487.00	2.70
39	601998	中信银行	45,413,224.00	2.70
40	601988	中国银行	44,934,686.00	2.67
41	601166	兴业银行	44,720,998.00	2.65
42	601857	中国石油	44,624,070.00	2.65
43	300760	迈瑞医疗	43,743,566.00	2.60
44	601668	中国建筑	43,686,375.00	2.59
45	601865	福莱特	43,258,931.59	2.57
46	600690	海尔智家	43,224,111.00	2.57
47	600015	华夏银行	42,577,381.19	2.53
48	600000	浦发银行	41,946,643.16	2.49
49	000066	中国长城	40,684,731.77	2.42
50	300474	景嘉微	40,031,684.73	2.38
51	600018	上港集团	39,323,351.00	2.33
52	300207	欣旺达	39,186,214.46	2.33
53	600699	均胜电子	38,606,610.19	2.29
54	601939	建设银行	38,180,551.00	2.27
55	002152	广电运通	37,899,219.75	2.25
56	601238	广汽集团	36,386,309.46	2.16
57	600999	招商证券	36,244,032.40	2.15
58	600019	宝钢股份	36,101,426.00	2.14
59	300433	蓝思科技	35,847,875.28	2.13
60	600016	民生银行	35,412,133.00	2.10
61	601231	环旭电子	34,937,918.58	2.07
62	600886	国投电力	34,752,485.97	2.06

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	601318	中国平安	122,550,974.10	7.28

2	002241	歌尔股份	92,181,809.50	5.47
3	601319	中国人保	83,890,242.00	4.98
4	600036	招商银行	71,776,499.00	4.26
5	600745	闻泰科技	71,096,725.56	4.22
6	300014	亿纬锂能	69,688,436.00	4.14
7	000333	美的集团	67,451,915.35	4.00
8	600519	贵州茅台	67,122,665.00	3.98
9	300433	蓝思科技	64,879,505.17	3.85
10	002410	广联达	64,452,472.40	3.83
11	600028	中国石化	60,865,803.70	3.61
12	000021	深科技	60,453,339.48	3.59
13	601288	农业银行	59,058,917.00	3.51
14	600460	士兰微	57,889,661.31	3.44
15	601877	正泰电器	57,268,257.96	3.40
16	600588	用友网络	56,626,342.00	3.36
17	601006	大秦铁路	56,161,916.00	3.33
18	601398	工商银行	56,123,779.00	3.33
19	601328	交通银行	55,062,080.00	3.27
20	300454	深信服	54,771,270.80	3.25
21	003816	中国广核	54,340,370.08	3.23
22	601211	国泰君安	53,260,917.00	3.16
23	601857	中国石油	52,336,952.38	3.11
24	600941	中国移动	52,179,225.00	3.10
25	600887	伊利股份	51,354,207.00	3.05
26	600100	同方股份	51,177,782.95	3.04
27	000651	格力电器	51,029,364.82	3.03
28	601818	光大银行	50,746,540.00	3.01
29	603160	汇顶科技	50,252,359.76	2.98
30	601688	华泰证券	49,391,475.80	2.93
31	300474	景嘉微	48,717,950.48	2.89
32	600183	生益科技	48,188,965.90	2.86
33	601169	北京银行	48,139,800.28	2.86
34	601988	中国银行	46,783,959.00	2.78
35	601658	邮储银行	46,200,356.00	2.74
36	600104	上汽集团	46,116,424.92	2.74
37	601998	中信银行	46,082,365.23	2.74
38	600000	浦发银行	44,501,987.22	2.64
39	601166	兴业银行	44,492,813.00	2.64
40	002384	东山精密	44,351,330.40	2.63
41	601898	中煤能源	43,380,696.00	2.58
42	600015	华夏银行	43,243,691.28	2.57
43	300207	欣旺达	43,155,531.92	2.56
44	600900	长江电力	43,059,221.66	2.56

45	300760	迈瑞医疗	42,946,345.21	2.55
46	601229	上海银行	42,097,703.89	2.50
47	601939	建设银行	39,788,136.30	2.36
48	000338	潍柴动力	38,054,506.94	2.26
49	603919	金徽酒	37,882,054.00	2.25
50	601601	中国太保	37,735,149.00	2.24
51	002152	广电运通	37,654,589.38	2.24
52	600570	恒生电子	36,924,609.00	2.19
53	002600	领益智造	36,828,589.00	2.19
54	600699	均胜电子	36,662,814.88	2.18
55	600886	国投电力	36,167,547.84	2.15
56	000066	中国长城	36,065,092.62	2.14
57	601238	广汽集团	35,870,497.84	2.13
58	300136	信维通信	35,330,920.58	2.10
59	688538	和辉光电	35,009,172.85	2.08
60	601231	环旭电子	34,991,435.94	2.08
61	600879	航天电子	34,770,473.00	2.06
62	002074	国轩高科	34,632,350.58	2.06
63	600016	民生银行	34,594,880.23	2.05
64	601919	中远海控	33,920,421.16	2.01
65	002558	巨人网络	33,734,958.06	2.00

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	8,738,580,507.08
卖出股票收入（成交）总额	9,069,441,245.03

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，根据中国建筑股份有限公司于 2023 年 07 月 25 日发布的公告，其受到晋安区城管局给予责令改正、罚款 2000 元的处罚；根据其于 2023 年 10 月 18 日发布的公告，其受到衡水市交通运输局给予责令限期改正、处 5000 元罚款的处罚；根据其于 2023 年 10 月 18 日发布的公告，其受到衡水市交通运输局给予责令立即停止作业、限期改正、处 10000 元罚款的处罚；根据其于 2024 年 01 月 26 日发布的公告，其受到晋安区城管局给予责令改正、并处罚款 2000 元的处罚；根据其于 2024 年 05 月 06 日发布的公告，其受到成都铁路监督管理局给予责令改正、处 489381.35 元罚款的行政处罚。根据宝山钢铁股份有限公司于 2023 年 08 月 04 日发布的公告，其受到上海市应急管理局给予罚款 30 万元的行政处罚。

除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金投资上述主体的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,120.38

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,120.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国金智享量化选股混合 A	6,694	90,522.57	13,816,327.80	2.28	592,141,751.50	97.72
国金智享量化选股混合 C	19,536	39,984.84	5,259,058.97	0.67	775,884,731.27	99.33
合计	26,230	52,882.27	19,075,386.77	1.38	1,368,026,482.77	98.62

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	国金智享量化选股混合 A	30,670.37	0.0051
	国金智享量化选股混合 C	68,602.37	0.0088
	合计	99,272.74	0.0072

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金智享量化选股混合 A	0
	国金智享量化选股混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国金智享量化选股混合 A	0
	国金智享量化选股混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
基金合同生效日 (2023 年 8 月 22 日) 基金份额总额	847,202,079.90	1,144,845,934.37
本报告期期初基金份额总额	780,456,800.53	1,013,329,690.13
本报告期基金总申购份额	48,001,244.90	48,065,683.82
减：本报告期基金总赎回份额	222,499,966.13	280,251,583.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	605,958,079.30	781,143,790.24

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	17,808,021,752.11	100.00	9,253,365.10	100.00	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。

(1) 基金交易单元的选择标准如下：

- ① 券商经纪人经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金使用券商交易单元的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	-	-	388,091,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024年01月11日
2	《国金基金管理有限公司关于本公司办公地址变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024年01月19日
3	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 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
4	《国金智享量化选股混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024年02月06日
5	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 A 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
6	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 C 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	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 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
8	《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
9	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 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
10	《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
11	《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
12	《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
13	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 A 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
14	《国金智享量化选股混合型证券投	指定披露媒体和本基金	2024年06月25日

	资基金（国金智享量化选股混合 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	基金管理人网站	
--	-----------------------------------	---------	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 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、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日