

国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	87
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	87
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	87
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	87
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	87
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	87
8.12 投资组合报告附注	88
§ 9 基金份额持有人信息	88
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	88
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	89
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	89
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	89
§ 10 开放式基金份额变动	89
§ 11 重大事件揭示	90
11.1 基金份额持有人大会决议	90
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	90
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	90
11.4 基金投资策略的改变	90
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	90
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	90
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	91
11.8 其他重大事件	95
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	97
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	97
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	97
§ 13 备查文件目录	97
13.1 备查文件目录	97
13.2 存放地点	97
13.3 查阅方式	97

§ 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	4,874,956,466.52 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	2,907,275,946.13 份	1,967,680,520.39 份

注：无

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。
业绩比较基准	85%×中证 500 指数收益率+15%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国金基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静
	联系电话	010-88005695
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com
客户服务电话	4000-2000-18	95566
传真	010-88005666	010-66594942
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100020	100818
法定代表人	邵海波	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街31号院1号楼三星大厦51层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
本期已实现收益	312,050,368.06	132,875,185.27	23,364,791.51	9,324,280.03	350,385.25	-
本期利润	287,885,578.93	87,196,769.42	-21,005,339.49	-9,906,449.20	327,517.25	-
加权平均基金份额本期利润	0.1252	0.0572	-0.1096	-0.0580	0.2480	-
本期加权平均净值利润率	6.10%	2.79%	-5.93%	-3.08%	16.53%	-
本期基金份额净值增长率	13.68%	13.24%	12.23%	6.01%	18.41%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	3,184,308,783.07	2,091,923,534.48	719,276,222.33	285,982,677.33	1,362,007.66	-

期末可供分配基金份额利润	1.0953	1.0631	0.8432	0.8420	0.6424	-
期末基金资产净值	6,091,584,729.20	4,104,133,966.05	1,572,336,395.68	625,614,744.47	3,482,113.37	-
期末基金份额净值	2.0953	2.0858	1.8432	1.8420	1.6424	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	109.53%	20.05%	84.32%	6.01%	64.24%	-

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多因子 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.73%	0.88%	-3.69%	0.73%	5.42%	0.15%
过去六个月	0.92%	0.80%	-7.77%	0.73%	8.69%	0.07%
过去一年	13.68%	0.80%	-5.52%	0.70%	19.20%	0.10%
过去三年	51.07%	1.09%	-10.31%	0.92%	61.38%	0.17%
过去五年	110.37%	1.16%	31.10%	1.09%	79.27%	0.07%
自基金合同生效起至今	109.53%	1.14%	30.58%	1.10%	78.95%	0.04%

国金量化多因子 C

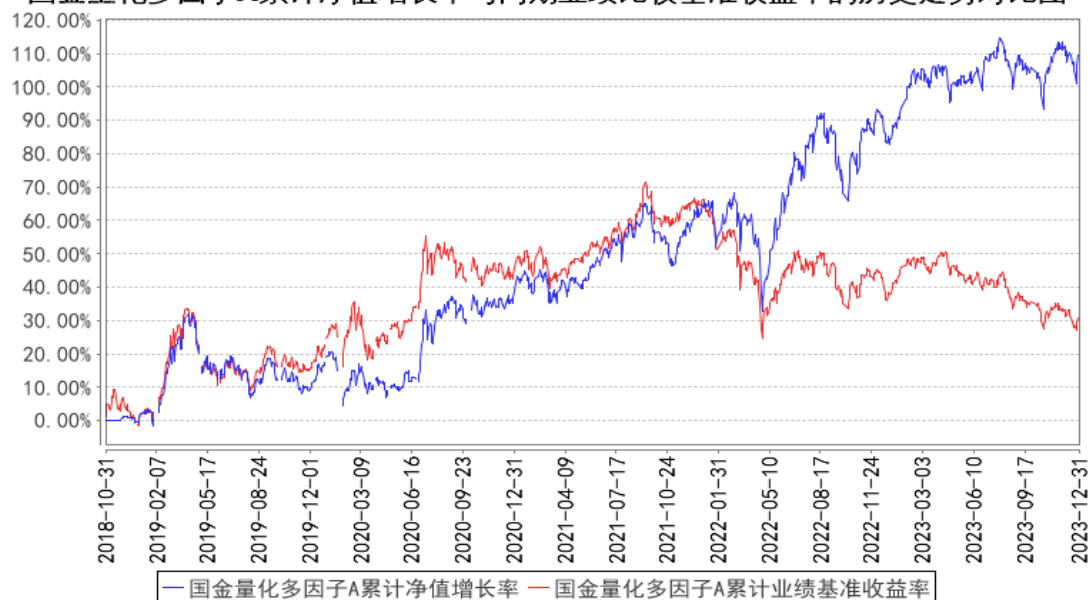
阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	1.63%	0.88%	-3.69%	0.73%	5.32%	0.15%
过去六个月	0.71%	0.80%	-7.77%	0.73%	8.48%	0.07%
过去一年	13.24%	0.80%	-5.52%	0.70%	18.76%	0.10%
自基金合同生效 起至今	20.05%	0.84%	-5.07%	0.73%	25.12%	0.11%

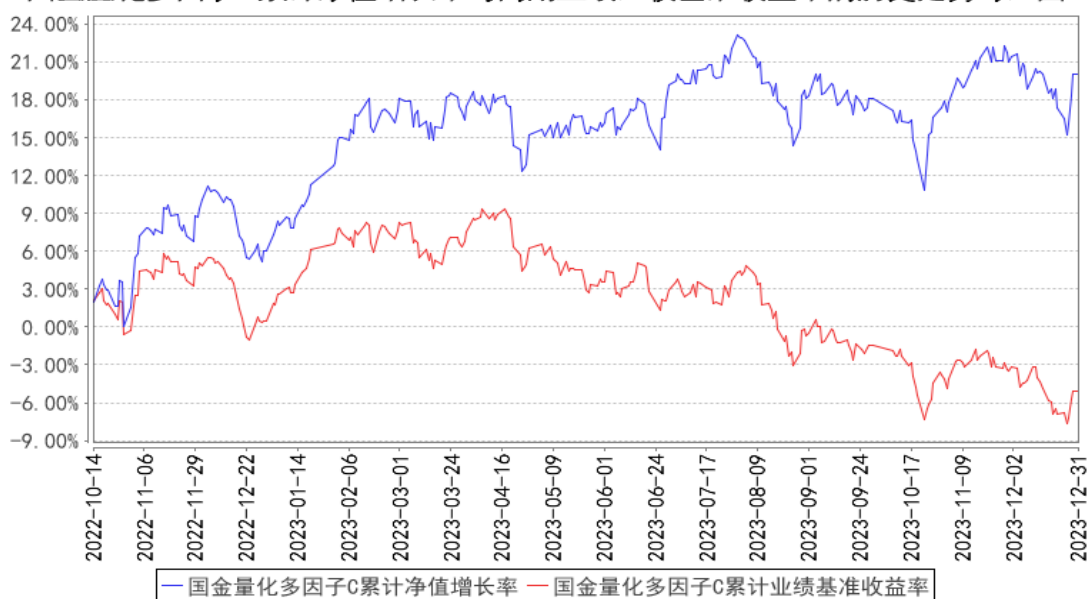
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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



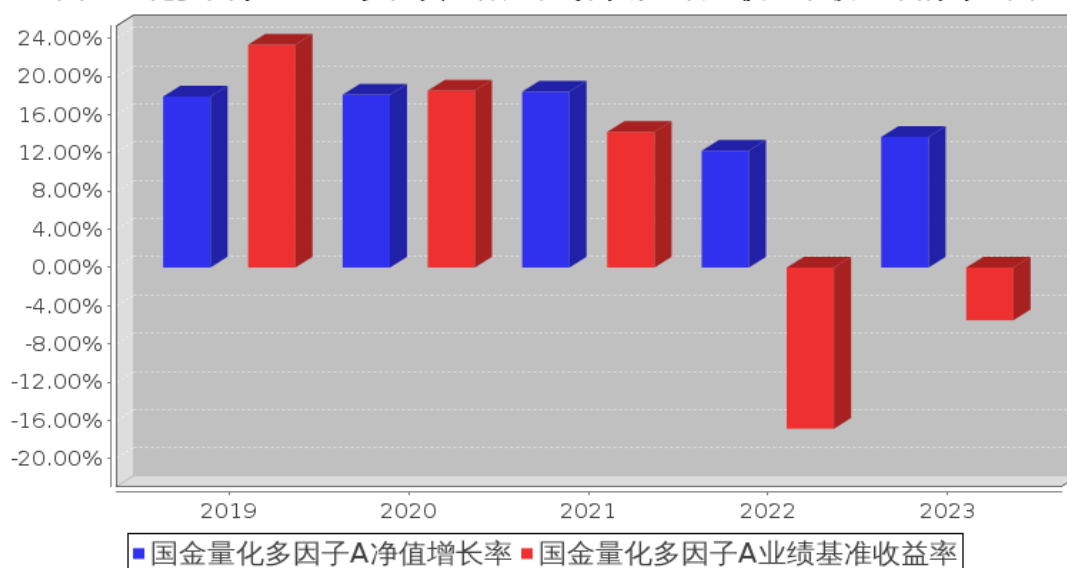
国金量化多因子C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



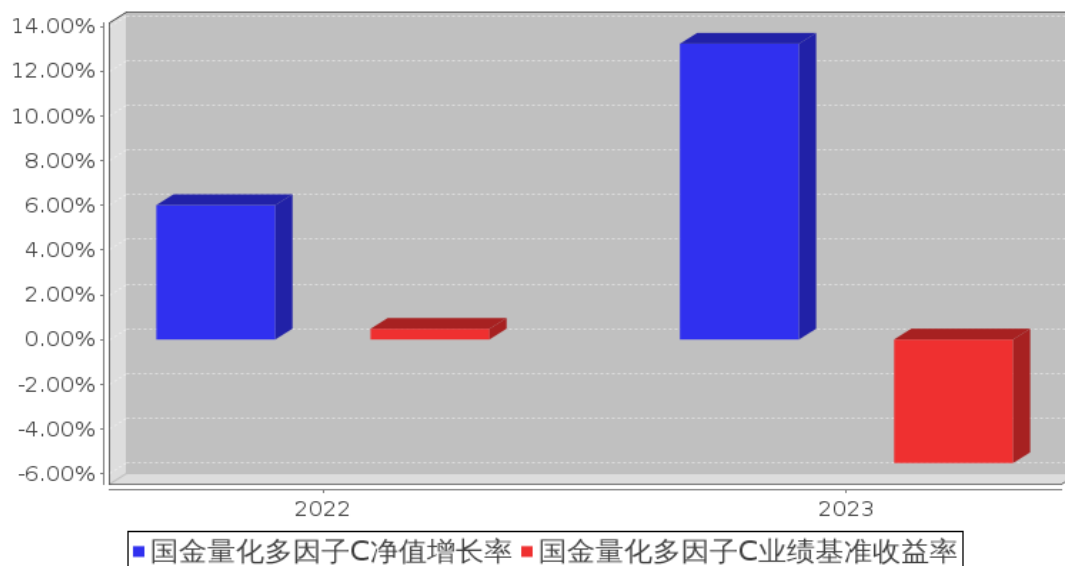
注：本基金 A 类合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，图示日期为 2018 年 10 月 31 日至 2023 年 12 月 31 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2022 年 10 月 14 日，图示日期为 2022 年 10 月 14 日至 2023 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多因子A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国金量化多因子C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

3.3 其他指标

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2023 年 12 月 31 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、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国

金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2020 年 9 月 3 日	-	7 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	-	19 年	姚加红先生，北京航空航天大学硕士。2004 年 4 月至 2011 年 5 月在博时基金管理有限公司任信息技术部高级程序员。2011 年 6 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部总经理、指数投资事业部副总经理，现任量化投资中心总经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
姚加红	公募基金	2	14,264,774,658.23	2023 年 1 月 5 日
	私募资产管理计划	5	1,022,873,471.15	2016 年 4 月 15 日

	其他组合	-	-	-
	合计	7	15,287,648,129.38	-

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

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任专户资产管理计划投资经理工作。

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合

参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 5 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

2023 年度市场环境看：各个市场风格切换较为频繁、延续性差，其中市值、动量、中盘和残差波动等波动较大。整体市场活跃度呈现前高后低的形态，市场波动大部分时间处于近三年较低水平位置，年底有所提升。具体因子层面：小市值风格整体占优，但二季度和年底延续性差，区间波动增大。行业涨跌方面，各行业（中信一级）在报告期内涨跌互现，其中通信、传媒和煤炭等行业涨幅相对较大，最高 24% 以上；消费者服务、房地产和电力设备及新能源等行业跌幅较大，最大跌幅 40% 以上。年度来看市场机会分布相对集中，特别是四季度以来，小盘和微盘收益相对市场平均水平持续提高。国金量化多因子股票型证券投资基金是量化多头产品，报告期内保持高仓位运作，此类产品持仓分散度高，全市场范围选股，投资追求信息比最大化，遇到市场机会较为集中的环境超额波动增大的概率增加。从 2023 年全年数据分析看，国金量化多因子股票型证券投资基金四季度超额波动有所增大，但从区间波动幅度和最大回撤指标看属于正常范围内的表现。

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 2.0953 元，累计单位净值为 2.0953 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 13.68%，同期业绩比较基准增长率为-5.52%。

本基金 C 类份额单位净值为 2.0858 元，累计单位净值为 2.0858 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 13.24%，同期业绩比较基准增长率为-5.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去三年随着全市场量化资管规模的逐步扩大，其在资产配置中的占比也有所提高。同时量化投资管理的规范也在近一年中落地更多细则，预期行业的发展稳健度或将有所提升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，本基金管理人制订的规章制度涵盖公司主要业务范围。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70015670_A14 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金量化多因子股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金量化多因子股票型证券投资基金的财

	务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金量化多因子股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金量化多因子股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化多因子股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于</p>

	<p>错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国金量化多因子股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金量化多因子股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蒋燕华 马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2024年03月29日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	533,589,354.26	223,205,008.38
结算备付金		46,815,213.75	13,397,948.95
存出保证金		4,881,490.85	679,289.71
交易性金融资产	7.4.7.2	9,647,785,304.10	1,799,016,672.88
其中：股票投资		9,366,157,331.49	1,799,016,672.88
基金投资		-	-
债券投资		281,627,972.61	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	244,680,403.80
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		84,048,991.73	63,200,104.24
应收股利		-	-
应收申购款		12,136,926.84	6,448,533.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		10,329,257,281.53	2,350,627,961.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	128,555,564.37
应付赎回款		110,173,605.05	19,102,384.33
应付管理人报酬		10,882,329.02	2,397,492.42
应付托管费		1,813,721.47	319,665.66
应付销售服务费		1,521,528.60	179,146.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	9,147,402.14	2,122,567.77
负债合计		133,538,586.28	152,676,821.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	4,874,956,466.52	1,192,692,240.49
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	5,320,762,228.73	1,005,258,899.66
净资产合计		10,195,718,695.25	2,197,951,140.15
负债和净资产总计		10,329,257,281.53	2,350,627,961.51

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，国金量化多因子 A 基金份额净值 2.0953 元，基金份额总额 2,907,275,946.13 份；国金量化多因子 C 基金份额净值 2.0858 元，基金份额总额 1,967,680,520.39 份。国金量化多因子份额总额合计为 4,874,956,466.52 份。

7.2 利润表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		505,524,128.97	-23,651,992.69
1. 利息收入		8,247,622.49	571,081.55
其中：存款利息收入	7.4.7.13	3,193,684.48	214,270.05
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		5,053,938.01	356,811.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		552,921,138.38	36,883,859.97
其中：股票投资收益	7.4.7.14	476,244,548.05	36,271,742.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	576,369.77	18.84
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	76,100,220.56	612,098.60
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-69,843,204.98	-63,600,860.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	14,198,573.08	2,493,926.02
减：二、营业总支出		130,441,780.62	7,259,796.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	102,308,715.80	6,096,281.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	15,506,925.59	812,837.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	12,339,546.74	272,458.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	286,592.49	78,217.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		375,082,348.35	-30,911,788.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		375,082,348.35	-30,911,788.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		375,082,348.35	-30,911,788.69

7.3 净资产变动表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,192,692,240.49	-	1,005,258,899.66	2,197,951,140.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,192,692,240.49	-	1,005,258,899.66	2,197,951,140.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,682,264,226.03	-	4,315,503,329.07	7,997,767,555.10
（一）、综合收益总额	-	-	375,082,348.35	375,082,348.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,682,264,226.03	-	3,940,420,980.72	7,622,685,206.75
其中：1. 基金申	7,619,408,025.	-	8,060,988,224.	15,680,396,250.

购款	42		66	08
2. 基金赎回款	-3,937,143,799.39	-	-4,120,567,243.94	-8,057,711,043.33
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,874,956,466.52	-	5,320,762,228.73	10,195,718,695.25
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,120,105.71	-	1,362,007.66	3,482,113.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,120,105.71	-	1,362,007.66	3,482,113.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,190,572,134.78	-	1,003,896,892.00	2,194,469,026.78
(一)、综合收益总额	-	-	-30,911,788.69	-30,911,788.69
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,190,572,134.78	-	1,034,808,680.69	2,225,380,815.47
其中：1. 基金申购款	1,475,106,809.54	-	1,268,541,419.01	2,743,648,228.55
2. 基金赎回款	-284,534,674.7	-	-233,732,738.3	-518,267,413.08

	6		2	
(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	1,192,692,240.49	-	1,005,258,899.66	2,197,951,140.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金量化多因子股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1050 号文的核准，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2018 年 10 月 31 日生效。首次募集规模为 249,293,966.03 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于 2022 年 10 月 14 日增设 C 类基金份额类别，本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许

基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货合约和股票期权需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特

征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确

定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

7.4.4.12 外币交易

无

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》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。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

7.4.6.4 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	533,589,354.26	223,205,008.38
等于：本金	533,530,615.46	223,175,160.34
加：应计利息	58,738.80	29,848.04
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	533,589,354.26	223,205,008.38

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	9,500,289,335.70	-	9,366,157,331.49	-134,132,004.21	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	279,246,642.00	1,641,972.61	281,627,972.61	739,358.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	279,246,642.00	1,641,972.61	281,627,972.61	739,358.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,779,535,977.70	1,641,972.61	9,647,785,304.10	-133,392,646.21	
项目	上年度末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,862,566,114.11	-	1,799,016,672.88	-63,549,441.23	
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	1,862,566,114.11	-	1,799,016,672.88	-63,549,441.23	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	244,680,403.80	-
银行间市场	-	-
合计	244,680,403.80	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

7.4.7.8 其他资产

注：无

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	20,076.66	32,134.97
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	8,907,325.48	2,040,432.80
其中：交易所市场	8,907,325.48	2,040,432.80
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	50,000.00
合计	9,147,402.14	2,122,567.77

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化多因子 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	853,060,173.35	853,060,173.35
本期申购	3,943,105,700.47	3,943,105,700.47
本期赎回（以“-”号填列）	-1,888,889,927.69	-1,888,889,927.69
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	2,907,275,946.13	2,907,275,946.13

国金量化多因子 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	339,632,067.14	339,632,067.14
本期申购	3,676,302,324.95	3,676,302,324.95
本期赎回（以“-”号填列）	-2,048,253,871.70	-2,048,253,871.70
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,967,680,520.39	1,967,680,520.39

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

7.4.7.11 其他综合收益

注：无

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金量化多因子 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	783,108,623.53	-63,832,401.20	719,276,222.33
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	783,108,623.53	-63,832,401.20	719,276,222.33
本期利润	312,050,368.06	-24,164,789.13	287,885,578.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,146,648,313.70	30,498,668.11	2,177,146,981.81
其中：基金申购款	4,133,318,603.70	22,374,007.53	4,155,692,611.23
基金赎回款	-1,986,670,290.00	8,124,660.58	-1,978,545,629.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,241,807,305.29	-57,498,522.22	3,184,308,783.07

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	296,993,929.13	-11,011,251.80	285,982,677.33
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	296,993,929.13	-11,011,251.80	285,982,677.33
本期利润	132,875,185.27	-45,678,415.85	87,196,769.42
本期基金份额交易产生的变动数	1,662,054,420.08	101,219,578.83	1,763,273,998.91
其中：基金申购款	3,750,904,658.90	154,390,954.53	3,905,295,613.43
基金赎回款	-2,088,850,238.82	-53,171,375.70	-2,142,021,614.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,091,923,534.48	44,529,911.18	2,136,453,445.66

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	2,237,335.44	164,119.97

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	898,266.43	48,116.21
其他	58,082.61	2,033.87
合计	3,193,684.48	214,270.05

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	476,244,548.05	36,271,742.53
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	476,244,548.05	36,271,742.53

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	42,991,302,810.08	2,265,886,105.44
减：卖出股票成本总额	42,434,290,550.60	2,224,109,536.33
减：交易费用	80,767,711.43	5,504,826.58
买卖股票差价收入	476,244,548.05	36,271,742.53

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	576,369.77	508.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-490.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	576,369.77	18.84

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	51,955.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	50,490.00
减：应计利息总额	-	1,955.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-490.00

注：无

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	76,100,220.56	612,098.60
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	76,100,220.56	612,098.60

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日

1. 交易性金融资产	-69,843,204.98	-63,600,860.23
股票投资	-70,582,562.98	-63,601,135.23
债券投资	739,358.00	275.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-69,843,204.98	-63,600,860.23

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	13,793,428.72	2,276,565.77
基金转换费收入	405,144.36	217,346.22
转出费	-	14.03
合计	14,198,573.08	2,493,926.02

7.4.7.22 信用减值损失

注：无

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	100,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	66,592.49	28,217.99
合计	286,592.49	78,217.99

7.4.7.24 分部报告

无

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国金证券股份有限公司	490,425,729.72	0.53	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

注：无

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

7.4.10.1.4 权证交易

注：无

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国金证券股份有 限公司	218,681.06	0.54	218,681.06	2.46
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	102,308,715.80	6,096,281.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	28,124,983.23	1,879,161.06
应支付基金管理人的净管理费	74,183,732.57	4,217,120.56

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。

3. 2023 年 8 月 7 日前，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 8 月 7 日起，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,506,925.59	812,837.51

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
国金基金管理有限公司	-	4,605,235.17	4,605,235.17
国金证券股份有限公司	-	477,846.54	477,846.54
合计	-	5,083,081.71	5,083,081.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
国金基金管理有限公司	-	73,103.58	73,103.58
国金证券股份有限公司	-	3,311.15	3,311.15
合计	-	76,414.73	76,414.73

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无

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

注：无

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行股份有限公司-活期存款	533,589,354.26	2,237,335.44	223,205,008.38

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300096	易联众	2023 年 12 月 29 日	重大事项停牌	6.82	2024 年 01 月 02 日	5.46	1,241,400	7,829,170.38	8,466,348.00	-
688337	普源精电	2023 年 12 月 25 日	重大事项停牌	43.87	2024 年 1 月 9 日	41.72	58,467	2,606,617.02	2,564,947.29	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后

完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

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

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	533,589,354.26	-	-	-	-	-	533,589,354.26
结算备付金	46,815,213.75	-	-	-	-	-	46,815,213.75
存出保证金	4,881,490.85	-	-	-	-	-	4,881,490.85
交易性金融资产	-	-	281,627,972.61	-	-	9,366,157,331.49	9,647,785,304.10
应收清算款	-	-	-	-	-	84,048,991.73	84,048,991.73
应收申购款	-	-	-	-	-	12,136,926.84	12,136,926.84
资产总计	585,286,058.86	-	281,627,972.61	-	-	9,462,343,250.06	10,329,257,281.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	110,173,605.05	110,173,605.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,882,329.02	10,882,329.02
应付托管费	-	-	-	-	-	1,813,721.47	1,813,721.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,521,528.60	1,521,528.60

其他负债	-	-	-	-	-	9,147,402.14	9,147,402.14
负债总计	-	-	-	-	-	133,538,586.28	133,538,586.28
利率敏感度缺口	585,286,058.86	-281,627,972.61	-	-	-9,328,804,663.78	10,195,718,695.25	
上年度末 2022年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	223,205,008.38	-	-	-	-	-	223,205,008.38
结算备付金	13,397,948.95	-	-	-	-	-	13,397,948.95
存出保证金	679,289.71	-	-	-	-	-	679,289.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,799,016,672.88	1,799,016,672.88
买入返售金融资产	244,680,403.80	-	-	-	-	-	244,680,403.80
应收清算款	-	-	-	-	-	63,200,104.24	63,200,104.24
应收申购款	-	-	-	-	-	6,448,533.55	6,448,533.55
资产总计	481,962,650.84	-	-	-	-	1,868,665,310.67	2,350,627,961.51
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	128,555,564.37	128,555,564.37
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,102,384.33	19,102,384.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,397,492.42	2,397,492.42
应付托管费	-	-	-	-	-	319,665.66	319,665.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	179,146.81	179,146.81
其他负债	-	-	-	-	-	2,122,567.77	2,122,567.77
负债总计	-	-	-	-	-	152,676,821.36	152,676,821.36
利率敏感度缺口	481,962,650.84	-	-	-	-	1,715,988,489.31	2,197,951,140.15

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,366,157,331.49	91.86	1,799,016,672.88	81.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	281,627,972.61	2.76	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,647,785,304.10	94.63	1,799,016,672.88	81.85

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变；	
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	+5%	433,359,625.94	100,885,721.14
	-5%	-433,359,625.94	-100,885,721.14

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	9,355,119,954.06	1,798,281,408.88
第二层次	292,659,267.90	735,264.00
第三层次	6,082.14	-
合计	9,647,785,304.10	1,799,016,672.88

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	8,866.03	8,866.03
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-2,783.89	-2,783.89
其中：计入损益的利得或损失	-	-2,783.89	-2,783.89
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	6,082.14	6,082.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-2,783.89	-2,783.89
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	-	-

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

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

单位：人民币元

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

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2024 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,366,157,331.49	90.68
	其中：股票	9,366,157,331.49	90.68
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	281,627,972.61	2.73
	其中：债券	281,627,972.61	2.73
	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	580,404,568.01	5.62
8	其他各项资产	101,067,409.42	0.98
9	合计	10,329,257,281.53	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	33,612,448.90	0.33
B	采矿业	59,525,057.70	0.58
C	制造业	7,354,789,266.91	72.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,231,745.32	0.67
E	建筑业	159,788,918.70	1.57
F	批发和零售业	221,860,546.88	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	20,764,802.80	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	694,102,271.02	6.81
J	金融业	269,029,231.32	2.64
K	房地产业	112,274,326.53	1.10
L	租赁和商务服务业	45,616,221.70	0.45
M	科学研究和技术服务业	119,990,968.81	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	142,031,204.83	1.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	704,985.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	17,834,884.00	0.17
S	综合	46,000,451.07	0.45
	合计	9,366,157,331.49	91.86

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601319	中国人保	13,182,316	63,802,409.44	0.63
2	603936	博敏电子	4,626,428	48,299,908.32	0.47
3	600808	马钢股份	16,776,000	45,630,720.00	0.45
4	600569	安阳钢铁	19,452,800	41,434,464.00	0.41
5	688538	和辉光电	16,425,647	39,914,322.21	0.39
6	600927	永安期货	2,521,500	39,612,765.00	0.39
7	600490	鹏欣资源	13,170,100	39,378,599.00	0.39
8	688173	希荻微	2,146,113	37,750,127.67	0.37
9	688209	英集芯	1,917,286	34,242,727.96	0.34
10	600810	神马股份	4,482,843	33,352,351.92	0.33
11	688031	星环科技	511,682	33,295,147.74	0.33
12	002092	中泰化学	5,306,800	32,371,480.00	0.32
13	688508	芯朋微	657,260	32,343,764.60	0.32
14	600581	八一钢铁	8,939,800	32,093,882.00	0.31
15	600782	新钢股份	9,188,600	32,068,214.00	0.31
16	600171	上海贝岭	2,231,100	31,726,242.00	0.31
17	600330	天通股份	3,651,953	31,516,354.39	0.31
18	601969	海南矿业	4,771,030	31,441,087.70	0.31
19	000627	天茂集团	10,843,900	30,796,676.00	0.30
20	601686	友发集团	5,002,300	30,764,145.00	0.30
21	002449	国星光电	3,155,100	29,878,797.00	0.29
22	000898	鞍钢股份	11,898,690	29,627,738.10	0.29
23	600346	恒力石化	2,226,300	29,320,371.00	0.29
24	000717	中南股份	11,221,500	28,502,610.00	0.28
25	000990	诚志股份	3,422,800	28,101,188.00	0.28
26	600990	四创电子	1,401,068	27,979,327.96	0.27
27	600643	爱建集团	5,375,790	27,416,529.00	0.27
28	600841	动力新科	4,582,400	27,081,984.00	0.27
29	600623	华谊集团	4,204,002	27,073,772.88	0.27
30	688403	汇成股份	2,562,693	27,036,411.15	0.27
31	603068	博通集成	923,800	26,928,770.00	0.26
32	000959	首钢股份	7,633,000	26,410,180.00	0.26
33	600770	综艺股份	5,316,077	26,101,938.07	0.26
34	688381	帝奥微	1,029,689	26,071,725.48	0.26
35	600231	凌钢股份	12,104,300	26,024,245.00	0.26
36	688327	云从科技	1,536,377	25,903,316.22	0.25
37	601728	中国电信	4,778,700	25,852,767.00	0.25
38	300221	银禧科技	4,293,161	25,758,966.00	0.25
39	000783	长江证券	4,731,800	25,457,084.00	0.25

40	601568	北元集团	5,367,280	25,440,907.20	0.25
41	601609	金田股份	3,756,500	25,431,505.00	0.25
42	002094	青岛金王	6,702,100	25,400,959.00	0.25
43	002165	红宝丽	5,985,000	25,316,550.00	0.25
44	600835	上海机电	2,121,400	25,181,018.00	0.25
45	601003	柳钢股份	7,858,676	24,912,002.92	0.24
46	600409	三友化工	4,441,300	24,382,737.00	0.24
47	000612	焦作万方	4,229,800	24,321,350.00	0.24
48	600802	福建水泥	4,672,160	24,201,788.80	0.24
49	300543	朗科智能	2,212,900	24,164,868.00	0.24
50	002382	蓝帆医疗	3,597,700	24,032,636.00	0.24
51	603113	金能科技	2,925,200	23,606,364.00	0.23
52	002798	帝欧家居	3,578,149	23,436,875.95	0.23
53	600594	益佰制药	4,118,800	23,435,972.00	0.23
54	002376	新北洋	3,075,150	23,432,643.00	0.23
55	600075	新疆天业	5,332,760	23,037,523.20	0.23
56	300132	青松股份	4,390,600	22,918,932.00	0.22
57	300076	GQY 视讯	4,197,100	22,916,166.00	0.22
58	000958	电投产融	5,806,500	22,877,610.00	0.22
59	002622	皓宸医疗	6,947,200	22,717,344.00	0.22
60	002110	三钢闽光	5,596,400	22,665,420.00	0.22
61	000949	新乡化纤	6,974,900	22,528,927.00	0.22
62	603700	宁水集团	1,546,800	22,072,836.00	0.22
63	002377	国创高新	8,704,300	22,021,879.00	0.22
64	605066	天正电气	2,356,100	21,628,998.00	0.21
65	300190	维尔利	5,156,300	21,553,334.00	0.21
66	300281	金明精机	3,583,500	21,465,165.00	0.21
67	300889	爱克股份	1,275,700	21,431,760.00	0.21
68	300739	明阳电路	1,385,120	21,206,187.20	0.21
69	600307	酒钢宏兴	14,171,400	21,115,386.00	0.21
70	300243	瑞丰高材	2,136,470	20,873,311.90	0.20
71	002278	神开股份	3,554,300	20,863,741.00	0.20
72	601828	美凯龙	5,348,310	20,697,959.70	0.20
73	000825	太钢不锈	5,548,983	20,697,706.59	0.20
74	600235	民丰特纸	3,325,100	20,416,114.00	0.20
75	002811	郑中设计	2,071,100	20,400,335.00	0.20
76	300306	远方信息	1,688,300	20,394,664.00	0.20
77	688299	长阳科技	1,460,857	20,378,955.15	0.20
78	001229	魅视科技	566,400	20,163,840.00	0.20
79	002296	辉煌科技	2,442,300	20,148,975.00	0.20
80	002730	电光科技	2,123,300	20,128,884.00	0.20
81	605058	澳弘电子	873,100	20,002,721.00	0.20
82	603818	曲美家居	3,682,700	19,886,580.00	0.20

83	600448	华纺股份	6,010,224	19,833,739.20	0.19
84	300640	德艺文创	3,086,400	19,814,688.00	0.19
85	600881	亚泰集团	10,099,050	19,693,147.50	0.19
86	603214	爱婴室	1,203,600	19,690,896.00	0.19
87	301135	瑞德智能	790,943	19,631,205.26	0.19
88	300877	金春股份	1,125,500	19,482,405.00	0.19
89	605166	聚合顺	1,963,900	19,481,888.00	0.19
90	688312	燕麦科技	942,652	19,465,763.80	0.19
91	605100	华丰股份	1,217,904	19,376,852.64	0.19
92	603980	吉华集团	4,146,000	19,361,820.00	0.19
93	688586	中航装备	1,733,610	19,225,734.90	0.19
94	600800	渤海化学	5,187,200	19,140,768.00	0.19
95	300484	蓝海华腾	1,511,900	19,095,297.00	0.19
96	688199	久日新材	705,221	19,062,123.63	0.19
97	300599	雄塑科技	2,376,000	19,055,520.00	0.19
98	603321	梅轮电梯	2,227,400	19,021,996.00	0.19
99	603657	春光科技	1,180,500	18,994,245.00	0.19
100	300891	惠云钛业	1,954,700	18,960,590.00	0.19
101	300259	新天科技	5,193,380	18,851,969.40	0.18
102	688380	中微半导	787,257	18,783,952.02	0.18
103	688330	宏力达	657,672	18,684,461.52	0.18
104	001211	双枪科技	773,100	18,678,096.00	0.18
105	603520	司太立	1,323,040	18,628,403.20	0.18
106	688360	德马科技	925,086	18,566,476.02	0.18
107	600984	建设机械	4,950,770	18,565,387.50	0.18
108	002467	二六三	4,001,000	18,564,640.00	0.18
109	600369	西南证券	4,518,600	18,481,074.00	0.18
110	603045	福达合金	1,170,000	18,474,300.00	0.18
111	688222	成都先导	1,225,722	18,373,572.78	0.18
112	002842	翔鹭钨业	2,102,170	18,330,922.40	0.18
113	300670	大烨智能	2,341,100	18,330,813.00	0.18
114	000910	大亚圣象	2,282,000	18,256,000.00	0.18
115	603937	丽岛新材	1,440,000	18,244,800.00	0.18
116	605003	众望布艺	914,200	18,046,308.00	0.18
117	603506	南都物业	1,657,500	18,017,025.00	0.18
118	603677	奇精机械	1,235,900	17,969,986.00	0.18
119	600527	江南高纤	9,196,420	17,933,019.00	0.18
120	000599	青岛双星	4,020,400	17,890,780.00	0.18
121	000608	阳光股份	6,206,240	17,873,971.20	0.18
122	300283	温州宏丰	2,800,500	17,811,180.00	0.17
123	688699	明微电子	441,174	17,801,370.90	0.17
124	000050	深天马A	1,669,900	17,784,435.00	0.17
125	002661	克明食品	1,864,800	17,771,544.00	0.17

126	301003	江苏博云	711,870	17,768,275.20	0.17
127	603041	美思德	1,319,323	17,758,087.58	0.17
128	600727	鲁北化工	2,694,072	17,726,993.76	0.17
129	300641	正丹股份	3,139,470	17,706,610.80	0.17
130	603225	新凤鸣	1,246,400	17,698,880.00	0.17
131	688655	迅捷兴	1,169,680	17,662,168.00	0.17
132	600184	光电股份	1,544,500	17,653,635.00	0.17
133	600207	安彩高科	3,697,200	17,635,644.00	0.17
134	000930	中粮科技	2,640,400	17,532,256.00	0.17
135	688011	新光光电	740,988	17,524,366.20	0.17
136	688391	钜泉科技	351,739	17,446,254.40	0.17
137	002743	富煌钢构	2,914,500	17,428,710.00	0.17
138	688183	生益电子	1,532,837	17,428,356.69	0.17
139	301006	迈拓股份	955,600	17,305,916.00	0.17
140	603577	汇金通	1,659,210	17,255,784.00	0.17
141	000635	英力特	1,921,300	17,234,061.00	0.17
142	300838	浙江力诺	1,050,900	17,192,724.00	0.17
143	301002	崧盛股份	826,560	17,142,854.40	0.17
144	000823	超声电子	1,773,404	16,971,476.28	0.17
145	688616	西力科技	1,242,018	16,941,125.52	0.17
146	300956	英力股份	905,000	16,860,150.00	0.17
147	601233	桐昆股份	1,113,400	16,845,742.00	0.17
148	603585	苏利股份	1,176,500	16,835,715.00	0.17
149	601366	利群股份	3,075,200	16,790,592.00	0.16
150	300323	华灿光电	2,291,800	16,775,976.00	0.16
151	300720	海川智能	1,205,000	16,761,550.00	0.16
152	603866	桃李面包	2,187,966	16,759,819.56	0.16
153	603511	爱慕股份	1,079,400	16,709,112.00	0.16
154	605189	富春染织	1,027,280	16,641,936.00	0.16
155	603898	好莱客	1,511,400	16,580,058.00	0.16
156	600628	新世界	2,360,200	16,545,002.00	0.16
157	688107	安路科技	447,430	16,456,475.40	0.16
158	688098	申联生物	2,176,577	16,280,795.96	0.16
159	002054	德美化工	2,373,900	16,142,520.00	0.16
160	603682	锦和商管	2,800,600	16,075,444.00	0.16
161	301055	张小泉	1,114,110	16,065,466.20	0.16
162	603115	海星股份	1,096,100	16,046,904.00	0.16
163	688589	力合微	398,873	15,919,021.43	0.16
164	605155	西大门	1,027,815	15,910,576.20	0.16
165	000532	华金资本	1,326,600	15,905,934.00	0.16
166	600714	金瑞矿业	1,655,501	15,892,809.60	0.16
167	002295	精艺股份	1,945,128	15,891,695.76	0.16
168	688588	凌志软件	1,334,554	15,881,192.60	0.16

169	600756	浪潮软件	1,143,900	15,865,893.00	0.16
170	601956	东贝集团	2,641,266	15,768,358.02	0.15
171	605303	园林股份	1,290,510	15,744,222.00	0.15
172	300562	乐心医疗	1,379,600	15,741,236.00	0.15
173	688365	光云科技	1,442,232	15,705,906.48	0.15
174	300230	永利股份	3,891,000	15,680,730.00	0.15
175	002722	物产金轮	1,017,100	15,673,511.00	0.15
176	300386	飞天诚信	1,454,800	15,610,004.00	0.15
177	688511	天微电子	494,788	15,570,978.36	0.15
178	003003	天元股份	1,352,300	15,537,927.00	0.15
179	605180	华生科技	1,104,170	15,458,380.00	0.15
180	002228	合兴包装	4,505,400	15,453,522.00	0.15
181	301189	奥尼电子	534,200	15,443,722.00	0.15
182	688015	交控科技	822,597	15,431,919.72	0.15
183	300932	三友联众	946,210	15,404,298.80	0.15
184	600192	长城电工	2,487,700	15,398,863.00	0.15
185	603385	惠达卫浴	1,910,600	15,303,906.00	0.15
186	300626	华瑞股份	1,409,800	15,296,330.00	0.15
187	601616	广电电气	4,200,101	15,246,366.63	0.15
188	600051	宁波联合	2,110,000	15,234,200.00	0.15
189	300472	新元科技	1,612,700	15,223,888.00	0.15
190	300849	锦盛新材	1,149,100	15,214,084.00	0.15
191	000655	金岭矿业	2,106,800	15,105,756.00	0.15
192	600356	恒丰纸业	1,889,300	15,076,614.00	0.15
193	600843	上工申贝	2,623,601	15,006,997.72	0.15
194	688171	纬德信息	664,737	14,956,582.50	0.15
195	300689	澄天伟业	769,163	14,898,687.31	0.15
196	301222	浙江恒威	496,000	14,746,080.00	0.14
197	300642	透景生命	833,300	14,707,745.00	0.14
198	300074	华平股份	3,165,500	14,656,265.00	0.14
199	301279	金道科技	591,200	14,655,848.00	0.14
200	605288	凯迪股份	311,000	14,654,320.00	0.14
201	002734	利民股份	1,833,368	14,611,942.96	0.14
202	688030	山石网科	729,145	14,597,482.90	0.14
203	300831	派瑞股份	1,189,900	14,588,174.00	0.14
204	603182	嘉华股份	983,100	14,520,387.00	0.14
205	001316	润贝航科	413,900	14,407,859.00	0.14
206	300046	台基股份	903,400	14,373,094.00	0.14
207	601996	丰林集团	5,042,200	14,370,270.00	0.14
208	300477	合纵科技	3,828,400	14,356,500.00	0.14
209	300385	雪浪环境	2,132,200	14,328,384.00	0.14
210	002148	北纬科技	2,372,100	14,327,484.00	0.14
211	002479	富春环保	2,994,690	14,284,671.30	0.14

212	688018	乐鑫科技	138,610	14,269,899.50	0.14
213	605336	帅丰电器	956,980	14,239,862.40	0.14
214	688080	映翰通	349,431	14,179,909.98	0.14
215	688136	科兴制药	700,038	14,175,769.50	0.14
216	000639	西王食品	3,203,273	14,158,466.66	0.14
217	605122	四方新材	875,690	14,124,879.70	0.14
218	301237	和顺科技	462,900	14,104,563.00	0.14
219	603583	捷昌驱动	704,100	14,103,123.00	0.14
220	688367	工大高科	789,721	14,088,622.64	0.14
221	300388	节能国祯	2,189,540	14,078,742.20	0.14
222	301026	浩通科技	460,400	14,019,180.00	0.14
223	300717	华信新材	834,100	14,004,539.00	0.14
224	002589	瑞康医药	4,274,400	13,977,288.00	0.14
225	002628	成都路桥	4,228,000	13,952,400.00	0.14
226	600227	赤天化	5,297,600	13,932,688.00	0.14
227	688038	中科通达	964,937	13,904,742.17	0.14
228	300752	隆利科技	763,600	13,874,612.00	0.14
229	688151	华强科技	747,422	13,872,152.32	0.14
230	000850	华茂股份	3,621,400	13,797,534.00	0.14
231	688061	灿瑞科技	343,693	13,747,720.00	0.13
232	300658	延江股份	2,030,300	13,745,131.00	0.13
233	600193	创兴资源	2,634,500	13,620,365.00	0.13
234	603261	立航科技	399,100	13,613,301.00	0.13
235	688216	气派科技	488,533	13,517,708.11	0.13
236	600693	东百集团	3,362,400	13,483,224.00	0.13
237	300907	康平科技	605,700	13,440,483.00	0.13
238	002636	金安国纪	1,502,600	13,388,166.00	0.13
239	002918	蒙娜丽莎	983,300	13,313,882.00	0.13
240	600261	阳光照明	4,067,200	13,299,744.00	0.13
241	688689	银河微电	477,049	13,295,355.63	0.13
242	688163	赛伦生物	664,541	13,284,174.59	0.13
243	300326	凯利泰	2,096,517	13,270,952.61	0.13
244	688613	奥精医疗	595,754	13,261,484.04	0.13
245	688128	中国电研	644,946	13,234,291.92	0.13
246	002688	金河生物	2,729,700	13,129,857.00	0.13
247	300671	富满微	404,300	13,071,019.00	0.13
248	688010	福光股份	543,013	13,064,892.78	0.13
249	600590	泰豪科技	1,951,730	13,037,556.40	0.13
250	688178	万德斯	718,082	12,982,922.56	0.13
251	300701	森霸传感	1,128,475	12,954,893.00	0.13
252	603416	信捷电气	344,300	12,931,908.00	0.13
253	300103	达刚控股	2,023,800	12,851,130.00	0.13
254	003041	真爱美家	770,648	12,831,289.20	0.13

255	002160	常铝股份	3,059,300	12,818,467.00	0.13
256	300808	久量股份	819,800	12,772,484.00	0.13
257	688181	八亿时空	472,693	12,762,711.00	0.13
258	688681	科汇股份	824,265	12,734,894.25	0.12
259	001256	炜冈科技	686,880	12,714,148.80	0.12
260	000626	远大控股	1,738,500	12,691,050.00	0.12
261	300120	经纬辉开	1,743,000	12,654,180.00	0.12
262	002715	登云股份	777,500	12,618,825.00	0.12
263	603978	深圳新星	758,800	12,580,904.00	0.12
264	688510	航亚科技	712,923	12,561,703.26	0.12
265	001218	丽臣实业	578,800	12,507,868.00	0.12
266	600126	杭钢股份	2,346,500	12,506,845.00	0.12
267	300072	海新能科	3,536,604	12,413,480.04	0.12
268	605500	森林包装	1,560,995	12,378,690.35	0.12
269	603601	再升科技	2,878,034	12,375,546.20	0.12
270	688057	金达莱	870,958	12,332,765.28	0.12
271	300920	润阳科技	584,300	12,299,515.00	0.12
272	300410	正业科技	1,393,800	12,251,502.00	0.12
273	601002	晋亿实业	2,523,100	12,211,804.00	0.12
274	301077	星华新材	597,700	12,151,241.00	0.12
275	300708	聚灿光电	1,076,400	12,141,792.00	0.12
276	003018	金富科技	1,138,200	12,121,830.00	0.12
277	001225	和泰机电	308,500	12,102,455.00	0.12
278	688287	观典防务	1,222,063	12,061,761.81	0.12
279	001216	华瓷股份	923,237	12,048,242.85	0.12
280	603212	赛伍技术	692,100	12,021,777.00	0.12
281	300903	科翔股份	1,194,620	12,017,877.20	0.12
282	300022	吉峰科技	2,427,500	11,967,575.00	0.12
283	003030	祖名股份	554,000	11,966,400.00	0.12
284	600824	益民集团	3,116,244	11,935,214.52	0.12
285	688395	正弦电气	518,058	11,910,153.42	0.12
286	002677	浙江美大	1,175,200	11,881,272.00	0.12
287	600883	博闻科技	1,397,298	11,877,033.00	0.12
288	300922	天秦装备	694,420	11,853,749.40	0.12
289	601218	吉鑫科技	2,960,300	11,841,200.00	0.12
290	600319	亚星化学	2,044,000	11,814,320.00	0.12
291	688013	天臣医疗	558,801	11,790,701.10	0.12
292	300703	创源股份	1,045,900	11,755,916.00	0.12
293	300040	九洲集团	2,098,300	11,750,480.00	0.12
294	301300	远翔新材	371,207	11,741,277.41	0.12
295	688021	奥福环保	562,812	11,734,630.20	0.12
296	688230	芯导科技	279,918	11,711,769.12	0.11
297	603787	新日股份	931,400	11,651,814.00	0.11

298	002718	友邦吊顶	683,600	11,628,036.00	0.11
299	603458	勘设股份	1,341,870	11,580,338.10	0.11
300	301176	逸豪新材	687,400	11,527,698.00	0.11
301	300787	海能实业	681,950	11,470,399.00	0.11
302	300176	派生科技	1,694,000	11,451,440.00	0.11
303	002637	赞宇科技	1,064,900	11,426,377.00	0.11
304	600851	海欣股份	1,662,400	11,420,688.00	0.11
305	002381	双箭股份	1,502,100	11,385,918.00	0.11
306	300349	金卡智能	912,100	11,328,282.00	0.11
307	300440	运达科技	1,519,800	11,322,510.00	0.11
308	603928	兴业股份	845,700	11,307,009.00	0.11
309	688571	杭华股份	1,510,016	11,294,919.68	0.11
310	300577	开润股份	764,600	11,216,682.00	0.11
311	300099	精准信息	1,802,803	11,159,350.57	0.11
312	601388	怡球资源	4,257,100	11,153,602.00	0.11
313	300930	屹通新材	465,700	11,139,544.00	0.11
314	601700	风范股份	2,218,500	11,114,685.00	0.11
315	301065	本立科技	485,450	11,043,987.50	0.11
316	300927	江天化学	654,140	11,022,259.00	0.11
317	688109	品茗科技	388,859	10,954,158.03	0.11
318	600345	长江通信	565,300	10,949,861.00	0.11
319	688468	科美诊断	1,008,486	10,881,563.94	0.11
320	688325	赛微微电	277,427	10,872,364.13	0.11
321	002969	嘉美包装	2,638,800	10,871,856.00	0.11
322	003001	中岩大地	598,300	10,811,281.00	0.11
323	688309	恒誉环保	540,804	10,794,447.84	0.11
324	600538	国发股份	2,319,400	10,762,016.00	0.11
325	688600	皖仪科技	531,821	10,742,784.20	0.11
326	603897	长城科技	523,806	10,727,546.88	0.11
327	002887	绿茵生态	1,234,300	10,713,724.00	0.11
328	300381	溢多利	1,453,300	10,710,821.00	0.11
329	688112	鼎阳科技	267,161	10,697,126.44	0.10
330	002365	永安药业	1,091,700	10,676,826.00	0.10
331	301388	欣灵电气	435,593	10,624,113.27	0.10
332	688669	聚石化学	560,400	10,501,896.00	0.10
333	600705	中航产融	3,375,000	10,496,250.00	0.10
334	000668	荣丰控股	826,200	10,492,740.00	0.10
335	300439	美康生物	901,395	10,465,195.95	0.10
336	002391	长青股份	1,659,850	10,457,055.00	0.10
337	601005	重庆钢铁	7,469,500	10,382,605.00	0.10
338	000987	越秀资本	1,724,194	10,379,647.88	0.10
339	603810	丰山集团	774,900	10,360,413.00	0.10
340	688459	哈铁科技	1,104,018	10,333,608.48	0.10

341	603356	华菱精工	702,500	10,277,575.00	0.10
342	002809	红墙股份	935,800	10,181,504.00	0.10
343	605259	绿田机械	445,600	10,115,120.00	0.10
344	603183	建研院	2,163,400	10,103,078.00	0.10
345	688215	瑞晟智能	279,492	10,047,737.40	0.10
346	688020	方邦股份	206,841	10,027,651.68	0.10
347	300082	奥克股份	1,433,700	9,992,889.00	0.10
348	603020	爱普股份	1,194,200	9,983,512.00	0.10
349	000718	苏宁环球	3,851,400	9,975,126.00	0.10
350	000059	华锦股份	1,815,800	9,968,742.00	0.10
351	002303	美盈森	2,828,400	9,927,684.00	0.10
352	002075	沙钢股份	2,592,300	9,902,586.00	0.10
353	300647	超频三	1,536,400	9,863,688.00	0.10
354	600433	冠豪高新	2,837,500	9,817,750.00	0.10
355	300616	尚品宅配	543,100	9,732,352.00	0.10
356	603330	天洋新材	1,283,100	9,725,898.00	0.10
357	688280	精进电动	1,267,668	9,723,013.56	0.10
358	603828	柯利达	2,533,900	9,679,498.00	0.09
359	688768	容知日新	261,727	9,634,170.87	0.09
360	688028	沃尔德	385,320	9,590,614.80	0.09
361	688175	高凌信息	342,320	9,560,997.60	0.09
362	000545	金浦钛业	3,150,800	9,546,924.00	0.09
363	301079	邵阳液压	551,630	9,543,199.00	0.09
364	000929	兰州黄河	973,200	9,537,360.00	0.09
365	688217	睿昂基因	266,401	9,531,827.78	0.09
366	688201	信安世纪	484,074	9,526,576.32	0.09
367	688528	秦川物联	862,024	9,525,365.20	0.09
368	300578	会畅通讯	533,100	9,521,166.00	0.09
369	600067	冠城大通	3,792,900	9,520,179.00	0.09
370	002522	浙江众成	1,978,800	9,518,028.00	0.09
371	300582	英飞特	792,300	9,515,523.00	0.09
372	603010	万盛股份	880,040	9,495,631.60	0.09
373	300329	海伦钢琴	1,272,300	9,478,635.00	0.09
374	002996	顺博合金	867,000	9,467,640.00	0.09
375	000601	韶能股份	2,211,700	9,466,076.00	0.09
376	605169	洪通燃气	835,390	9,464,968.70	0.09
377	603637	镇海股份	1,042,300	9,380,700.00	0.09
378	300214	日科化学	1,442,000	9,373,000.00	0.09
379	688505	复旦张江	1,013,420	9,353,866.60	0.09
380	002297	博云新材	1,171,700	9,338,449.00	0.09
381	688660	电气风电	1,811,835	9,312,831.90	0.09
382	000881	中广核技	1,276,400	9,253,900.00	0.09
383	003008	开普检测	330,700	9,229,837.00	0.09

384	688257	新锐股份	368,517	9,227,665.68	0.09
385	605268	王力安防	941,500	9,170,210.00	0.09
386	002286	保龄宝	1,129,200	9,169,104.00	0.09
387	002686	亿利达	1,351,000	9,146,270.00	0.09
388	688288	鸿泉物联	384,881	9,144,772.56	0.09
389	600722	金牛化工	1,829,800	9,130,702.00	0.09
390	603916	苏博特	895,500	9,125,145.00	0.09
391	600855	航天长峰	848,200	9,092,704.00	0.09
392	002486	嘉麟杰	3,108,400	9,076,528.00	0.09
393	600573	惠泉啤酒	869,200	9,022,296.00	0.09
394	688379	华光新材	452,947	8,954,762.19	0.09
395	300829	金丹科技	427,700	8,930,376.00	0.09
396	300843	胜蓝股份	386,900	8,890,962.00	0.09
397	300193	佳士科技	1,131,100	8,788,647.00	0.09
398	002035	华帝股份	1,413,800	8,779,698.00	0.09
399	300894	火星人	539,100	8,754,984.00	0.09
400	300824	北鼎股份	967,450	8,736,073.50	0.09
401	688067	爱威科技	366,892	8,735,698.52	0.09
402	002105	信隆健康	1,344,436	8,711,945.28	0.09
403	603339	四方科技	732,540	8,709,900.60	0.09
404	300004	南风股份	1,407,200	8,696,496.00	0.09
405	002398	垒知集团	1,822,258	8,692,170.66	0.09
406	300696	爱乐达	497,680	8,664,608.80	0.08
407	688656	浩欧博	248,927	8,652,702.52	0.08
408	300279	和晶科技	1,326,600	8,583,102.00	0.08
409	600741	华域汽车	527,100	8,581,188.00	0.08
410	688049	炬芯科技	225,345	8,578,884.15	0.08
411	301359	东南电子	322,300	8,576,403.00	0.08
412	002214	大立科技	745,551	8,551,469.97	0.08
413	002646	天佑德酒	627,536	8,540,764.96	0.08
414	002109	兴化股份	1,798,100	8,522,994.00	0.08
415	600668	尖峰集团	770,700	8,516,235.00	0.08
416	603718	海利生物	795,100	8,515,521.00	0.08
417	002775	文科园林	2,126,032	8,504,128.00	0.08
418	688148	芳源股份	1,107,690	8,495,982.30	0.08
419	300096	易联众	1,241,400	8,466,348.00	0.08
420	688081	兴图新科	490,953	8,449,301.13	0.08
421	002663	普邦股份	4,660,300	8,435,143.00	0.08
422	688509	正元地信	1,743,625	8,421,708.75	0.08
423	600935	华塑股份	2,478,300	8,351,871.00	0.08
424	301361	众智科技	349,100	8,322,544.00	0.08
425	300195	长荣股份	1,223,700	8,321,160.00	0.08
426	688661	和林微纳	181,204	8,302,767.28	0.08

427	688092	爱科科技	269,310	8,283,975.60	0.08
428	300667	必创科技	481,600	8,264,256.00	0.08
429	603378	亚士创能	976,000	8,256,960.00	0.08
430	300117	嘉寓股份	2,839,000	8,233,100.00	0.08
431	603686	福龙马	804,100	8,225,943.00	0.08
432	002695	煌上煌	783,500	8,203,245.00	0.08
433	600076	康欣新材	3,087,100	8,180,815.00	0.08
434	002342	巨力索具	1,897,600	8,178,656.00	0.08
435	300800	力合科技	594,300	8,124,081.00	0.08
436	688165	埃夫特	704,182	8,069,925.72	0.08
437	300441	鲍斯股份	1,168,900	8,053,721.00	0.08
438	603331	百达精工	614,385	8,048,443.50	0.08
439	300870	欧陆通	181,000	8,012,870.00	0.08
440	300265	通光线缆	864,600	8,006,196.00	0.08
441	603126	中材节能	1,180,300	7,955,222.00	0.08
442	003016	欣贺股份	970,300	7,927,351.00	0.08
443	688189	南新制药	839,851	7,919,794.93	0.08
444	603150	万朗磁塑	272,600	7,919,030.00	0.08
445	688370	丛麟科技	320,334	7,912,249.80	0.08
446	301196	唯科科技	229,600	7,893,648.00	0.08
447	688078	龙软科技	195,697	7,890,503.04	0.08
448	603527	众源新材	729,171	7,882,338.51	0.08
449	002879	长缆科技	489,800	7,846,596.00	0.08
450	301040	中环海陆	413,600	7,845,992.00	0.08
451	000020	深华发 A	601,500	7,789,425.00	0.08
452	605299	舒华体育	783,100	7,752,690.00	0.08
453	300486	东杰智能	1,120,900	7,745,419.00	0.08
454	600539	狮头股份	1,080,000	7,743,600.00	0.08
455	002815	崇达技术	806,800	7,729,144.00	0.08
456	300673	佩蒂股份	577,360	7,678,888.00	0.08
457	601588	北辰实业	4,036,900	7,670,110.00	0.08
458	002225	濮耐股份	2,018,400	7,629,552.00	0.07
459	003019	宸展光电	337,569	7,629,059.40	0.07
460	600667	太极实业	1,082,300	7,608,569.00	0.07
461	603238	诺邦股份	550,450	7,568,687.50	0.07
462	300935	盈建科	276,100	7,567,901.00	0.07
463	301150	中一科技	227,000	7,550,020.00	0.07
464	603813	原尚股份	464,300	7,498,445.00	0.07
465	300819	聚杰微纤	482,200	7,498,210.00	0.07
466	300067	安诺其	2,410,000	7,495,100.00	0.07
467	605033	美邦股份	415,500	7,458,225.00	0.07
468	300884	狄耐克	569,960	7,455,076.80	0.07
469	000938	紫光股份	384,500	7,440,075.00	0.07

470	603151	邦基科技	492,495	7,431,749.55	0.07
471	300248	新开普	772,200	7,405,398.00	0.07
472	301197	工大科雅	393,500	7,393,865.00	0.07
473	688023	安恒信息	66,468	7,370,636.52	0.07
474	688132	邦彦技术	342,872	7,347,746.96	0.07
475	300557	理工光科	207,690	7,316,918.70	0.07
476	301123	奕东电子	311,469	7,307,062.74	0.07
477	603365	水星家纺	506,700	7,286,346.00	0.07
478	688004	博汇科技	247,520	7,269,662.40	0.07
479	300501	海顺新材	502,400	7,249,632.00	0.07
480	688090	瑞松科技	222,164	7,195,891.96	0.07
481	603096	新经典	365,000	7,183,200.00	0.07
482	003025	思进智能	531,255	7,177,255.05	0.07
483	605389	长龄液压	268,120	7,174,891.20	0.07
484	002242	九阳股份	563,000	7,155,730.00	0.07
485	600052	东望时代	1,432,600	7,148,674.00	0.07
486	600746	江苏索普	975,830	7,143,075.60	0.07
487	300986	志特新材	559,791	7,126,139.43	0.07
488	603272	联翔股份	421,800	7,119,984.00	0.07
489	300187	永清环保	1,321,500	7,109,670.00	0.07
490	688045	必易微	164,886	7,062,067.38	0.07
491	603221	爱丽家居	709,400	7,051,436.00	0.07
492	300876	蒙泰高新	281,600	7,045,632.00	0.07
493	600691	阳煤化工	2,194,900	7,045,629.00	0.07
494	600488	津药药业	1,435,100	7,031,990.00	0.07
495	300906	日月明	277,200	7,010,388.00	0.07
496	300695	兆丰股份	132,000	6,990,720.00	0.07
497	688697	纽威数控	371,184	6,989,394.72	0.07
498	002111	威海广泰	770,560	6,981,273.60	0.07
499	688558	国盛智科	245,391	6,969,104.40	0.07
500	688056	莱伯泰科	207,970	6,969,074.70	0.07
501	688338	赛科希德	207,405	6,968,808.00	0.07
502	605298	必得科技	446,750	6,964,832.50	0.07
503	603886	元祖股份	378,600	6,901,878.00	0.07
504	603333	尚纬股份	1,207,600	6,895,396.00	0.07
505	002227	奥特迅	515,000	6,885,550.00	0.07
506	300234	开尔新材	1,319,900	6,876,679.00	0.07
507	300211	亿通科技	679,900	6,873,789.00	0.07
508	600371	万向德农	640,330	6,870,740.90	0.07
509	603968	醋化股份	481,000	6,835,010.00	0.07
510	600493	凤竹纺织	1,014,000	6,814,080.00	0.07
511	605287	德才股份	399,600	6,781,212.00	0.07
512	603579	荣泰健康	323,900	6,746,837.00	0.07

513	002084	海鸥住工	1,686,600	6,712,668.00	0.07
514	605507	国邦医药	381,022	6,690,746.32	0.07
515	300449	汉邦高科	990,300	6,654,816.00	0.07
516	300852	四会富仕	172,500	6,648,150.00	0.07
517	600998	九州通	945,000	6,624,450.00	0.06
518	603685	晨丰科技	432,300	6,609,867.00	0.06
519	603587	地素时尚	500,400	6,560,244.00	0.06
520	001333	光华股份	295,100	6,533,514.00	0.06
521	603678	火炬电子	246,050	6,512,943.50	0.06
522	002650	加加食品	1,595,600	6,510,048.00	0.06
523	603618	杭电股份	1,015,000	6,496,000.00	0.06
524	301309	万得凯	229,400	6,411,730.00	0.06
525	300162	雷曼光电	791,400	6,410,340.00	0.06
526	603669	灵康药业	1,157,000	6,398,210.00	0.06
527	002912	中新赛克	228,400	6,392,916.00	0.06
528	600894	广日股份	869,600	6,391,560.00	0.06
529	300127	银河磁体	369,000	6,387,390.00	0.06
530	002134	天津普林	581,925	6,383,717.25	0.06
531	603881	数据港	320,740	6,357,066.80	0.06
532	300155	安居宝	1,073,400	6,354,528.00	0.06
533	301469	C恒达	188,000	6,352,520.00	0.06
534	001332	锡装股份	193,310	6,350,233.50	0.06
535	002012	凯恩股份	1,132,600	6,342,560.00	0.06
536	300771	智莱科技	578,550	6,288,838.50	0.06
537	688055	龙腾光电	1,287,427	6,282,643.76	0.06
538	002732	燕塘乳业	327,200	6,282,240.00	0.06
539	603109	神驰机电	382,000	6,272,440.00	0.06
540	002574	明牌珠宝	1,043,300	6,259,800.00	0.06
541	002218	拓日新能	1,387,700	6,258,527.00	0.06
542	300719	安达维尔	468,600	6,246,438.00	0.06
543	300411	金盾股份	890,700	6,225,993.00	0.06
544	600495	晋西车轴	1,453,400	6,220,552.00	0.06
545	600812	华北制药	1,090,800	6,217,560.00	0.06
546	603017	中衡设计	619,800	6,204,198.00	0.06
547	605158	华达新材	814,660	6,191,416.00	0.06
548	688227	品高股份	323,588	6,170,823.16	0.06
549	600382	广东明珠	1,363,600	6,163,472.00	0.06
550	600470	六国化工	1,054,400	6,157,696.00	0.06
551	603508	思维列控	392,200	6,157,540.00	0.06
552	300237	美晨生态	2,875,900	6,154,426.00	0.06
553	688077	大地熊	257,763	6,147,647.55	0.06
554	300591	万里马	1,015,800	6,145,590.00	0.06
555	600446	金证股份	530,603	6,139,076.71	0.06

556	001230	劲旅环境	261,428	6,133,100.88	0.06
557	300447	全信股份	422,400	6,124,800.00	0.06
558	002412	汉森制药	898,100	6,089,118.00	0.06
559	002440	闰土股份	997,100	6,082,310.00	0.06
560	603012	创力集团	1,029,000	6,081,390.00	0.06
561	600650	锦江在线	632,800	6,055,896.00	0.06
562	603551	奥普家居	571,800	6,055,362.00	0.06
563	600558	大西洋	1,486,900	6,051,683.00	0.06
564	603758	秦安股份	528,500	6,046,040.00	0.06
565	300464	星徽股份	1,000,700	6,024,214.00	0.06
566	603819	神力股份	420,800	6,021,648.00	0.06
567	300397	天和防务	581,000	5,995,920.00	0.06
568	688168	安博通	165,249	5,975,403.84	0.06
569	300467	迅游科技	343,500	5,970,030.00	0.06
570	688373	盟科药业	914,065	5,968,844.45	0.06
571	300546	雄帝科技	378,260	5,965,160.20	0.06
572	301193	家联科技	351,220	5,963,715.60	0.06
573	600774	汉商集团	604,770	5,963,032.20	0.06
574	603217	元利科技	326,100	5,948,064.00	0.06
575	600359	新农开发	802,500	5,946,525.00	0.06
576	300710	万隆光电	244,100	5,936,512.00	0.06
577	688129	东来技术	358,615	5,935,078.25	0.06
578	300886	华业香料	239,600	5,934,892.00	0.06
579	300420	五洋停车	1,942,770	5,906,020.80	0.06
580	301314	科瑞思	134,980	5,890,527.20	0.06
581	300834	星辉环材	275,100	5,881,638.00	0.06
582	001259	利仁科技	207,300	5,870,736.00	0.06
583	300610	晨化股份	513,200	5,783,764.00	0.06
584	603533	掌阅科技	290,800	5,781,104.00	0.06
585	605060	联德股份	305,600	5,714,720.00	0.06
586	002968	新大正	455,700	5,700,807.00	0.06
587	600104	上汽集团	418,900	5,667,717.00	0.06
588	300992	泰福泵业	259,900	5,608,642.00	0.06
589	688308	欧科亿	200,714	5,599,920.60	0.05
590	688113	联测科技	120,211	5,582,598.84	0.05
591	603105	芯能科技	480,900	5,568,822.00	0.05
592	300321	同大股份	287,500	5,563,125.00	0.05
593	688335	复洁环保	433,377	5,560,226.91	0.05
594	600237	铜峰电子	714,400	5,529,456.00	0.05
595	603966	法兰泰克	675,800	5,528,044.00	0.05
596	688290	景业智能	115,666	5,525,364.82	0.05
597	300946	恒而达	170,100	5,489,127.00	0.05
598	601138	工业富联	362,500	5,481,000.00	0.05

599	002774	快意电梯	656,900	5,452,270.00	0.05
600	688455	科捷智能	427,132	5,428,847.72	0.05
601	002325	洪涛股份	3,420,300	5,404,074.00	0.05
602	000923	河钢资源	321,600	5,402,880.00	0.05
603	603976	正川股份	270,100	5,323,671.00	0.05
604	688060	云涌科技	113,139	5,305,087.71	0.05
605	688247	宣泰医药	479,672	5,266,798.56	0.05
606	603328	依顿电子	643,400	5,243,710.00	0.05
607	300943	春晖智控	364,700	5,229,798.00	0.05
608	688096	京源环保	557,070	5,219,745.90	0.05
609	002899	英派斯	315,200	5,216,560.00	0.05
610	300515	三德科技	450,100	5,194,154.00	0.05
611	300241	瑞丰光电	920,000	5,179,600.00	0.05
612	300535	达威股份	294,757	5,161,195.07	0.05
613	688585	上纬新材	609,119	5,159,237.93	0.05
614	002949	华阳国际	369,200	5,157,724.00	0.05
615	600288	大恒科技	452,900	5,154,002.00	0.05
616	300018	中元股份	842,500	5,147,675.00	0.05
617	603216	梦天家居	391,200	5,132,544.00	0.05
618	688314	康拓医疗	155,955	5,132,479.05	0.05
619	600337	美克家居	1,857,500	5,126,700.00	0.05
620	688607	康众医疗	250,822	5,111,752.36	0.05
621	300289	利德曼	830,400	5,106,960.00	0.05
622	300399	天利科技	368,000	5,093,120.00	0.05
623	300222	科大智能	689,000	5,071,040.00	0.05
624	300227	光韵达	645,900	5,063,856.00	0.05
625	603988	中电电机	444,700	5,056,239.00	0.05
626	688051	佳华科技	151,193	5,042,286.55	0.05
627	688135	利扬芯片	225,763	5,036,772.53	0.05
628	600909	华安证券	1,031,300	5,032,744.00	0.05
629	603823	百合花	510,900	5,027,256.00	0.05
630	603165	荣晟环保	418,700	5,016,026.00	0.05
631	688255	凯尔达	204,562	5,001,540.90	0.05
632	000566	海南海药	1,103,100	4,986,012.00	0.05
633	002392	北京利尔	1,318,100	4,982,418.00	0.05
634	603956	威派格	626,300	4,972,822.00	0.05
635	600379	宝光股份	494,300	4,967,715.00	0.05
636	688277	天智航	375,289	4,946,309.02	0.05
637	300925	法本信息	420,551	4,941,474.25	0.05
638	603500	祥和实业	401,700	4,920,825.00	0.05
639	688628	优利德	124,655	4,911,407.00	0.05
640	300976	达瑞电子	91,928	4,893,327.44	0.05
641	603776	永安行	347,500	4,892,800.00	0.05

642	300333	兆日科技	662,900	4,892,202.00	0.05
643	002066	瑞泰科技	439,900	4,887,289.00	0.05
644	002474	榕基软件	741,100	4,876,438.00	0.05
645	603059	倍加洁	216,100	4,875,216.00	0.05
646	688058	宝兰德	103,023	4,863,715.83	0.05
647	300295	三六五网	394,400	4,862,952.00	0.05
648	002403	爱仕达	567,200	4,855,232.00	0.05
649	300050	世纪鼎利	1,024,000	4,843,520.00	0.05
650	301108	洁雅股份	139,800	4,828,692.00	0.05
651	688219	会通股份	438,713	4,812,681.61	0.05
652	600854	春兰股份	912,600	4,809,402.00	0.05
653	603909	建发合诚	422,500	4,799,600.00	0.05
654	688662	富信科技	131,584	4,796,236.80	0.05
655	300030	阳普医疗	615,200	4,767,800.00	0.05
656	688793	倍轻松	141,479	4,760,768.35	0.05
657	603797	联泰环保	861,700	4,756,584.00	0.05
658	688115	思林杰	137,152	4,755,059.84	0.05
659	688203	海正生材	364,904	4,751,050.08	0.05
660	688419	耐科装备	133,538	4,747,275.90	0.05
661	600281	华阳新材	1,021,000	4,737,440.00	0.05
662	600080	金花股份	635,000	4,730,750.00	0.05
663	000972	中基健康	1,330,700	4,723,985.00	0.05
664	603192	汇得科技	239,400	4,704,210.00	0.05
665	688069	德林海	236,004	4,691,759.52	0.05
666	603895	天永智能	181,400	4,676,492.00	0.05
667	603336	宏辉果蔬	909,900	4,649,589.00	0.05
668	688022	瀚川智能	210,799	4,624,930.06	0.05
669	688184	帕瓦股份	237,555	4,622,820.30	0.05
670	301503	智迪科技	137,000	4,608,680.00	0.05
671	688622	禾信仪器	128,076	4,604,332.20	0.05
672	603790	雅运股份	325,900	4,565,859.00	0.04
673	301105	鸿铭股份	121,103	4,557,105.89	0.04
674	002873	新天药业	361,000	4,498,060.00	0.04
675	603755	日辰股份	168,900	4,489,362.00	0.04
676	603311	金海高科	433,800	4,485,492.00	0.04
677	688211	中科微至	122,267	4,483,530.89	0.04
678	300881	盛德鑫泰	175,200	4,481,616.00	0.04
679	300519	新光药业	269,600	4,467,272.00	0.04
680	300296	利亚德	744,100	4,464,600.00	0.04
681	000430	张家界	683,100	4,446,981.00	0.04
682	600618	氯碱化工	487,300	4,434,430.00	0.04
683	301063	海锅股份	193,800	4,418,640.00	0.04
684	002455	百川股份	595,300	4,417,126.00	0.04

685	603610	麒盛科技	370,384	4,414,977.28	0.04
686	300962	中金辐照	283,500	4,399,920.00	0.04
687	300511	雪榕生物	817,800	4,375,230.00	0.04
688	603839	安正时尚	527,000	4,374,100.00	0.04
689	603208	江山欧派	147,100	4,367,399.00	0.04
690	600684	珠江股份	1,244,039	4,316,815.33	0.04
691	300062	中能电气	690,620	4,302,562.60	0.04
692	300512	中亚股份	509,300	4,283,213.00	0.04
693	601688	华泰证券	306,000	4,268,700.00	0.04
694	688244	永信至诚	76,293	4,256,386.47	0.04
695	002626	金达威	260,100	4,247,433.00	0.04
696	688053	思科瑞	84,683	4,229,069.02	0.04
697	688291	金橙子	147,686	4,201,666.70	0.04
698	300448	浩云科技	779,400	4,193,172.00	0.04
699	600366	宁波韵升	539,300	4,190,361.00	0.04
700	002910	庄园牧场	382,600	4,185,644.00	0.04
701	300916	朗特智能	170,212	4,159,981.28	0.04
702	002144	宏达高科	357,500	4,154,150.00	0.04
703	605399	晨光新材	305,800	4,146,648.00	0.04
704	600707	彩虹股份	613,700	4,142,475.00	0.04
705	300625	三雄极光	278,400	4,125,888.00	0.04
706	000931	中关村	699,800	4,107,826.00	0.04
707	300454	深信服	56,720	4,100,288.80	0.04
708	603683	晶华新材	364,100	4,099,766.00	0.04
709	688398	赛特新材	129,575	4,094,570.00	0.04
710	603727	博迈科	325,000	4,072,250.00	0.04
711	301180	万祥科技	224,600	4,063,014.00	0.04
712	002871	伟隆股份	362,900	4,057,222.00	0.04
713	600390	五矿资本	863,600	4,041,648.00	0.04
714	603580	艾艾精工	270,500	4,027,745.00	0.04
715	600749	西藏旅游	340,500	4,004,280.00	0.04
716	600865	百大集团	489,824	3,996,963.84	0.04
717	600797	浙大网新	605,400	3,971,424.00	0.04
718	300994	久祺股份	269,300	3,958,710.00	0.04
719	688678	福立旺	215,027	3,958,647.07	0.04
720	000554	泰山石油	682,000	3,935,140.00	0.04
721	605006	山东玻纤	569,520	3,929,688.00	0.04
722	300141	和顺电气	375,500	3,920,220.00	0.04
723	688026	洁特生物	225,612	3,889,550.88	0.04
724	000702	正虹科技	618,700	3,879,249.00	0.04
725	000833	粤桂股份	624,200	3,863,798.00	0.04
726	605056	咸亨国际	246,000	3,835,140.00	0.04
727	300126	锐奇股份	536,000	3,832,400.00	0.04

728	600616	金枫酒业	610,400	3,821,104.00	0.04
729	300789	唐源电气	168,500	3,797,990.00	0.04
730	300963	中洲特材	289,300	3,795,616.00	0.04
731	301086	鸿富瀚	81,750	3,778,485.00	0.04
732	300851	交大思诺	121,000	3,771,570.00	0.04
733	300412	迦南科技	662,030	3,766,950.70	0.04
734	300371	汇中股份	308,100	3,755,739.00	0.04
735	300879	大叶股份	216,800	3,754,976.00	0.04
736	001202	炬申股份	213,700	3,754,709.00	0.04
737	600262	北方股份	194,700	3,747,975.00	0.04
738	603507	振江股份	144,600	3,746,586.00	0.04
739	300500	启迪设计	261,400	3,745,862.00	0.04
740	600505	西昌电力	440,500	3,739,845.00	0.04
741	300651	金陵体育	187,000	3,736,260.00	0.04
742	301248	杰创智能	212,150	3,735,961.50	0.04
743	300810	中科海讯	183,000	3,733,200.00	0.04
744	002857	三晖电气	226,200	3,732,300.00	0.04
745	300270	中威电子	481,200	3,714,864.00	0.04
746	603102	百合股份	95,500	3,703,490.00	0.04
747	688393	安必平	148,173	3,699,879.81	0.04
748	601216	君正集团	989,000	3,698,860.00	0.04
749	300783	三只松鼠	204,200	3,685,810.00	0.04
750	688557	兰剑智能	100,039	3,684,436.37	0.04
751	600969	郴电国际	566,400	3,681,600.00	0.04
752	300621	维业股份	320,000	3,676,800.00	0.04
753	002998	优彩资源	462,200	3,674,490.00	0.04
754	300746	汉嘉设计	364,900	3,667,245.00	0.04
755	688205	德科立	73,986	3,660,827.28	0.04
756	600644	乐山电力	524,400	3,649,824.00	0.04
757	002696	百洋股份	551,100	3,648,282.00	0.04
758	000590	启迪药业	406,700	3,644,032.00	0.04
759	600082	海泰发展	1,055,700	3,642,165.00	0.04
760	002435	长江健康	872,800	3,639,576.00	0.04
761	300756	金马游乐	224,200	3,632,040.00	0.04
762	301066	万事利	281,800	3,629,584.00	0.04
763	300152	新动力	1,240,900	3,623,428.00	0.04
764	301045	天禄科技	133,100	3,620,320.00	0.04
765	002394	联发股份	435,300	3,617,343.00	0.04
766	603116	红蜻蜓	577,500	3,615,150.00	0.04
767	688218	江苏北人	180,419	3,584,925.53	0.04
768	600847	万里股份	300,500	3,581,960.00	0.04
769	600653	中华控股	1,930,700	3,571,795.00	0.04
770	001206	依依股份	226,300	3,571,014.00	0.04

771	605001	威奥股份	533,600	3,569,784.00	0.04
772	003036	泰坦股份	287,700	3,567,480.00	0.03
773	600097	开创国际	333,400	3,564,046.00	0.03
774	000880	潍柴重机	335,100	3,562,113.00	0.03
775	688170	德龙激光	91,187	3,560,852.35	0.03
776	600735	新华锦	552,000	3,560,400.00	0.03
777	603578	三星新材	249,500	3,560,365.00	0.03
778	603838	四通股份	493,900	3,556,080.00	0.03
779	688633	星球石墨	113,796	3,553,849.08	0.03
780	002431	棕榈股份	1,399,000	3,553,460.00	0.03
781	688296	和达科技	196,863	3,537,628.11	0.03
782	000681	视觉中国	238,300	3,503,010.00	0.03
783	002360	同德化工	479,500	3,500,350.00	0.03
784	601798	蓝科高新	459,600	3,497,556.00	0.03
785	002107	沃华医药	573,763	3,482,741.41	0.03
786	002132	恒星科技	1,111,500	3,478,995.00	0.03
787	688456	有研粉材	123,306	3,473,530.02	0.03
788	002301	齐心集团	481,700	3,424,887.00	0.03
789	688707	振华新材	166,538	3,414,029.00	0.03
790	688786	悦安新材	76,815	3,413,658.60	0.03
791	603076	乐惠国际	126,800	3,398,240.00	0.03
792	688246	嘉和美康	101,386	3,388,320.12	0.03
793	603829	洛凯股份	207,100	3,381,943.00	0.03
794	002097	山河智能	549,300	3,367,209.00	0.03
795	301395	仁信新材	176,400	3,318,084.00	0.03
796	000042	中洲控股	577,300	3,313,702.00	0.03
797	688158	优刻得	201,023	3,306,828.35	0.03
798	301198	喜悦智行	272,100	3,303,294.00	0.03
799	002206	海利得	657,400	3,300,148.00	0.03
800	688597	煜邦电力	362,342	3,297,312.20	0.03
801	600108	亚盛集团	1,182,900	3,288,462.00	0.03
802	002763	汇洁股份	388,300	3,265,603.00	0.03
803	300153	科泰电源	408,900	3,263,022.00	0.03
804	603058	永吉股份	358,400	3,250,688.00	0.03
805	002950	奥美医疗	341,300	3,235,524.00	0.03
806	603989	艾华集团	149,300	3,212,936.00	0.03
807	600216	浙江医药	298,200	3,199,686.00	0.03
808	688679	通源环境	249,111	3,196,094.13	0.03
809	002224	三力士	626,000	3,186,340.00	0.03
810	300348	长亮科技	308,600	3,181,666.00	0.03
811	300868	杰美特	146,000	3,171,120.00	0.03
812	301043	绿岛风	96,100	3,145,353.00	0.03
813	301009	可靠股份	293,400	3,127,644.00	0.03

814	002481	双塔食品	703,500	3,102,435.00	0.03
815	603320	迪贝电气	194,900	3,100,859.00	0.03
816	688350	富淼科技	186,823	3,088,184.19	0.03
817	000017	深中华 A	709,300	3,085,455.00	0.03
818	688231	隆达股份	139,708	3,074,973.08	0.03
819	688718	唯赛勃	205,534	3,070,677.96	0.03
820	603856	东宏股份	262,900	3,068,043.00	0.03
821	300950	德固特	189,300	3,053,409.00	0.03
822	600857	宁波中百	323,700	3,052,491.00	0.03
823	300871	回盛生物	211,000	3,051,060.00	0.03
824	603811	诚意药业	293,620	3,044,839.40	0.03
825	300885	海昌新材	288,800	3,043,952.00	0.03
826	688226	威腾电气	160,786	3,022,776.80	0.03
827	688267	中触媒	156,396	3,005,931.12	0.03
828	603387	基蛋生物	273,000	3,003,000.00	0.03
829	301082	久盛电气	165,000	2,994,750.00	0.03
830	688329	艾隆科技	118,670	2,950,136.20	0.03
831	688095	福昕软件	42,114	2,941,662.90	0.03
832	605305	中际联合	89,500	2,891,745.00	0.03
833	688353	华盛锂电	105,422	2,888,562.80	0.03
834	002672	东江环保	558,100	2,863,053.00	0.03
835	600381	青海春天	370,000	2,860,100.00	0.03
836	300622	博士眼镜	143,100	2,837,673.00	0.03
837	600526	菲达环保	573,800	2,834,572.00	0.03
838	002759	天际股份	266,800	2,830,748.00	0.03
839	600300	维维股份	908,211	2,824,536.21	0.03
840	601825	沪农商行	485,600	2,787,344.00	0.03
841	301200	大族数控	73,520	2,776,850.40	0.03
842	603709	中源家居	154,240	2,776,320.00	0.03
843	300305	裕兴股份	280,600	2,772,328.00	0.03
844	603022	新通联	269,100	2,771,730.00	0.03
845	002523	天桥起重	995,700	2,768,046.00	0.03
846	002593	日上集团	685,200	2,747,652.00	0.03
847	300107	建新股份	515,051	2,745,221.83	0.03
848	002191	劲嘉股份	507,193	2,723,626.41	0.03
849	300422	博世科	454,500	2,722,455.00	0.03
850	300692	中环环保	436,800	2,708,160.00	0.03
851	603188	亚邦股份	639,100	2,703,393.00	0.03
852	300425	中建环能	576,800	2,699,424.00	0.03
853	688162	巨一科技	84,839	2,689,396.30	0.03
854	000565	渝三峡 A	423,300	2,671,023.00	0.03
855	000586	汇源通信	211,200	2,656,896.00	0.03
856	002923	润都股份	214,880	2,651,619.20	0.03

857	603558	健盛集团	273,300	2,648,277.00	0.03
858	300749	顶固集创	284,100	2,633,607.00	0.03
859	603237	五芳斋	89,860	2,632,898.00	0.03
860	688517	金冠电气	166,598	2,630,582.42	0.03
861	605080	浙江自然	123,600	2,616,612.00	0.03
862	300453	三鑫医疗	342,500	2,613,275.00	0.03
863	688337	普源精电	58,467	2,564,947.29	0.03
864	301182	凯旺科技	109,300	2,555,434.00	0.03
865	300931	通用电梯	296,700	2,504,148.00	0.02
866	300743	天地数码	180,138	2,500,315.44	0.02
867	600962	国投中鲁	206,700	2,490,735.00	0.02
868	688285	高铁电气	280,186	2,488,051.68	0.02
869	688519	南亚新材	96,526	2,486,509.76	0.02
870	300753	爱朋医疗	144,000	2,472,480.00	0.02
871	603303	得邦照明	192,400	2,472,340.00	0.02
872	301008	宏昌科技	81,700	2,466,523.00	0.02
873	002963	豪尔赛	159,100	2,466,050.00	0.02
874	301010	晶雪节能	131,600	2,459,604.00	0.02
875	300369	绿盟科技	260,700	2,458,401.00	0.02
876	601566	九牧王	246,300	2,455,611.00	0.02
877	300897	山科智能	71,730	2,453,166.00	0.02
878	688237	超卓航科	64,536	2,438,170.08	0.02
879	300998	宁波方正	104,900	2,421,092.00	0.02
880	603798	康普顿	249,400	2,411,698.00	0.02
881	300830	金现代	298,800	2,411,316.00	0.02
882	002492	恒基达鑫	402,500	2,410,975.00	0.02
883	301081	严牌股份	216,500	2,403,150.00	0.02
884	603268	松发股份	138,400	2,391,552.00	0.02
885	300960	通业科技	107,400	2,382,132.00	0.02
886	688355	明志科技	119,447	2,376,995.30	0.02
887	688611	杭州柯林	72,337	2,371,206.86	0.02
888	301326	捷邦科技	58,500	2,346,435.00	0.02
889	002136	安纳达	201,900	2,346,078.00	0.02
890	300407	凯发电气	247,900	2,340,176.00	0.02
891	000663	永安林业	289,600	2,339,968.00	0.02
892	688229	博睿数据	48,491	2,330,962.37	0.02
893	603086	先达股份	395,300	2,324,364.00	0.02
894	603112	华翔股份	189,800	2,306,070.00	0.02
895	688317	之江生物	109,735	2,302,240.30	0.02
896	600979	广安爱众	664,900	2,300,554.00	0.02
897	688682	霍莱沃	48,017	2,290,891.07	0.02
898	688225	亚信安全	124,652	2,286,117.68	0.02
899	301156	美农生物	120,880	2,279,796.80	0.02

900	300423	昇辉科技	240,500	2,275,130.00	0.02
901	605178	时空科技	81,100	2,248,903.00	0.02
902	301059	金三江	184,800	2,239,776.00	0.02
903	688085	三友医疗	114,148	2,225,886.00	0.02
904	000062	深圳华强	197,316	2,223,751.32	0.02
905	601113	华鼎股份	646,100	2,216,123.00	0.02
906	688320	禾川科技	53,452	2,191,532.00	0.02
907	600588	用友网络	122,700	2,182,833.00	0.02
908	300163	先锋新材	567,400	2,178,816.00	0.02
909	688766	普冉股份	22,024	2,157,911.52	0.02
910	688101	三达膜	158,775	2,137,111.50	0.02
911	002196	方正电机	295,400	2,120,972.00	0.02
912	603822	嘉澳环保	76,100	2,116,341.00	0.02
913	688432	有研硅	170,904	2,110,664.40	0.02
914	605138	盛泰集团	271,700	2,105,675.00	0.02
915	603172	万丰股份	118,300	2,085,629.00	0.02
916	300154	瑞凌股份	280,000	2,072,000.00	0.02
917	002753	永东股份	248,500	2,050,125.00	0.02
918	301335	天元宠物	95,680	2,047,552.00	0.02
919	603228	景旺电子	90,100	2,032,656.00	0.02
920	688130	晶华微	49,656	2,028,447.60	0.02
921	300900	广联航空	82,100	2,026,228.00	0.02
922	300460	惠伦晶体	165,000	2,022,900.00	0.02
923	600467	好当家	844,800	2,010,624.00	0.02
924	300955	嘉亨家化	90,900	2,009,799.00	0.02
925	300605	恒锋信息	133,200	1,994,004.00	0.02
926	002172	澳洋健康	522,800	1,981,412.00	0.02
927	600408	安泰集团	813,100	1,975,833.00	0.02
928	300564	筑博设计	146,500	1,971,890.00	0.02
929	300245	天玑科技	223,100	1,967,742.00	0.02
930	002826	易明医药	164,300	1,950,241.00	0.02
931	688206	概伦电子	89,326	1,947,306.80	0.02
932	300111	向日葵	639,700	1,944,688.00	0.02
933	002361	神剑股份	493,600	1,939,848.00	0.02
934	300137	先河环保	348,400	1,937,104.00	0.02
935	300095	华伍股份	231,600	1,906,068.00	0.02
936	688369	致远互联	54,787	1,896,178.07	0.02
937	301148	嘉戎技术	85,800	1,891,890.00	0.02
938	301295	美硕科技	56,871	1,887,548.49	0.02
939	603180	金牌厨柜	74,800	1,876,732.00	0.02
940	688093	世华科技	102,334	1,863,502.14	0.02
941	300967	晓鸣股份	130,200	1,859,256.00	0.02
942	001696	宗申动力	280,067	1,856,844.21	0.02

943	300247	融捷健康	520,600	1,853,336.00	0.02
944	600819	耀皮玻璃	362,300	1,844,107.00	0.02
945	600716	凤凰股份	491,700	1,809,456.00	0.02
946	603733	仙鹤股份	112,000	1,807,680.00	0.02
947	300880	迦南智能	89,500	1,782,840.00	0.02
948	300882	万胜智能	72,400	1,763,664.00	0.02
949	603833	欧派家居	25,300	1,761,133.00	0.02
950	002820	桂发祥	154,200	1,760,964.00	0.02
951	300915	海融科技	53,500	1,756,940.00	0.02
952	688196	卓越新能	52,270	1,754,703.90	0.02
953	002272	川润股份	250,800	1,715,472.00	0.02
954	002199	东晶电子	182,400	1,710,912.00	0.02
955	688119	中钢洛耐	347,505	1,695,824.40	0.02
956	600793	宜宾纸业	145,900	1,695,358.00	0.02
957	300518	盛讯达	98,580	1,683,746.40	0.02
958	301056	森赫股份	164,100	1,677,102.00	0.02
959	002404	嘉欣丝绸	277,400	1,675,496.00	0.02
960	688087	英科再生	68,965	1,660,677.20	0.02
961	300845	捷安高科	90,900	1,642,563.00	0.02
962	000698	沈阳化工	388,300	1,638,626.00	0.02
963	605378	野马电池	64,104	1,623,754.32	0.02
964	600889	南京化纤	278,300	1,603,008.00	0.02
965	603920	世运电路	87,200	1,594,016.00	0.02
966	603517	绝味食品	59,300	1,592,798.00	0.02
967	301223	中荣股份	87,700	1,589,124.00	0.02
968	300632	光莆股份	120,800	1,524,496.00	0.01
969	603530	神马电力	72,200	1,497,428.00	0.01
970	002956	西麦食品	103,700	1,486,021.00	0.01
971	301110	青木股份	36,900	1,483,749.00	0.01
972	300021	大禹节水	305,300	1,453,228.00	0.01
973	301016	雷尔伟	65,600	1,447,136.00	0.01
974	603681	永冠新材	94,500	1,426,950.00	0.01
975	600758	辽宁能源	391,700	1,417,954.00	0.01
976	605366	宏柏新材	170,980	1,414,004.60	0.01
977	603187	海容冷链	91,900	1,393,204.00	0.01
978	603706	东方环宇	83,700	1,383,561.00	0.01
979	600271	航天信息	129,400	1,376,816.00	0.01
980	301138	华研精机	47,400	1,374,600.00	0.01
981	601238	广汽集团	156,700	1,371,125.00	0.01
982	300191	潜能恒信	87,300	1,350,531.00	0.01
983	688526	科前生物	66,157	1,348,279.66	0.01
984	600640	国脉文化	116,700	1,338,549.00	0.01
985	002779	中坚科技	53,400	1,328,058.00	0.01

986	603316	诚邦股份	195,200	1,315,648.00	0.01
987	000751	锌业股份	404,200	1,313,650.00	0.01
988	601555	东吴证券	179,300	1,310,683.00	0.01
989	003017	大洋生物	53,800	1,308,416.00	0.01
990	300865	大宏立	57,300	1,286,385.00	0.01
991	688711	宏微科技	30,948	1,284,032.52	0.01
992	600664	哈药股份	382,400	1,281,040.00	0.01
993	301355	南王科技	84,000	1,272,600.00	0.01
994	688191	智洋创新	68,621	1,269,488.50	0.01
995	300635	中达安	100,400	1,263,032.00	0.01
996	002980	华盛昌	45,900	1,257,660.00	0.01
997	603948	建业股份	54,600	1,241,604.00	0.01
998	300334	津膜科技	160,100	1,239,174.00	0.01
999	688273	麦澜德	36,191	1,205,522.21	0.01
1,000	603222	济民医疗	150,400	1,204,704.00	0.01
1,001	300995	奇德新材	56,500	1,201,755.00	0.01
1,002	600380	健康元	96,200	1,195,766.00	0.01
1,003	603917	合力科技	67,300	1,195,248.00	0.01
1,004	002285	世联行	494,600	1,191,986.00	0.01
1,005	000788	北大医药	175,600	1,178,276.00	0.01
1,006	301167	建研设计	68,800	1,164,096.00	0.01
1,007	300384	三联虹普	72,800	1,161,888.00	0.01
1,008	688232	新点软件	31,888	1,154,345.60	0.01
1,009	300523	辰安科技	56,800	1,153,040.00	0.01
1,010	301161	唯万密封	56,900	1,150,518.00	0.01
1,011	603955	大千生态	78,130	1,147,729.70	0.01
1,012	600156	华升股份	228,700	1,125,204.00	0.01
1,013	688567	孚能科技	68,899	1,123,742.69	0.01
1,014	002402	和而泰	78,300	1,118,907.00	0.01
1,015	300866	安克创新	12,500	1,107,500.00	0.01
1,016	605183	确成股份	75,500	1,104,565.00	0.01
1,017	300758	七彩化学	108,700	1,098,957.00	0.01
1,018	600354	敦煌种业	182,700	1,096,200.00	0.01
1,019	002408	齐翔腾达	207,200	1,094,016.00	0.01
1,020	603335	迪生力	162,700	1,091,717.00	0.01
1,021	000504	南华生物	93,800	1,088,080.00	0.01
1,022	603995	甬金股份	56,200	1,080,726.00	0.01
1,023	300923	研奥股份	43,900	1,076,428.00	0.01
1,024	300424	航新科技	81,300	1,065,030.00	0.01
1,025	603351	威尔药业	39,900	1,052,163.00	0.01
1,026	002582	好想你	137,100	1,051,557.00	0.01
1,027	301023	江南奕帆	25,200	1,045,800.00	0.01
1,028	300665	飞鹿股份	120,900	1,044,576.00	0.01

1,029	300150	世纪瑞尔	213,400	1,034,990.00	0.01
1,030	300947	德必集团	65,200	1,022,988.00	0.01
1,031	300929	华骐环保	83,963	1,021,829.71	0.01
1,032	300892	品渥食品	41,300	1,021,349.00	0.01
1,033	600066	宇通客车	76,300	1,010,975.00	0.01
1,034	300618	寒锐钴业	35,690	1,009,670.10	0.01
1,035	000505	京粮控股	147,600	1,009,584.00	0.01
1,036	300147	香雪制药	194,700	1,002,705.00	0.01
1,037	002836	新宏泽	114,504	1,001,910.00	0.01
1,038	300732	设研院	113,000	997,790.00	0.01
1,039	301212	联盛化学	36,900	996,300.00	0.01
1,040	603166	福达股份	143,700	992,967.00	0.01
1,041	300837	浙矿股份	33,000	985,710.00	0.01
1,042	002745	木林森	113,800	985,508.00	0.01
1,043	603602	纵横通信	66,000	972,840.00	0.01
1,044	603630	拉芳家化	63,200	966,960.00	0.01
1,045	301226	祥明智能	41,620	950,184.60	0.01
1,046	600867	通化东宝	87,600	948,708.00	0.01
1,047	600053	九鼎投资	67,100	948,123.00	0.01
1,048	688121	卓然股份	46,708	944,902.84	0.01
1,049	301273	瑞晨环保	33,800	932,542.00	0.01
1,050	001205	盛航股份	56,140	919,011.80	0.01
1,051	002917	金奥博	92,400	911,988.00	0.01
1,052	300839	博汇股份	88,800	908,424.00	0.01
1,053	603122	合富中国	111,700	899,185.00	0.01
1,054	000953	河化股份	164,300	898,721.00	0.01
1,055	600137	浪莎股份	48,800	889,136.00	0.01
1,056	301037	保立佳	43,660	870,143.80	0.01
1,057	002633	申科股份	73,400	858,046.00	0.01
1,058	300823	建科机械	38,500	828,135.00	0.01
1,059	301195	北路智控	20,300	823,774.00	0.01
1,060	301365	矩阵股份	54,400	822,528.00	0.01
1,061	300711	广哈通信	61,564	821,879.40	0.01
1,062	600180	瑞茂通	134,500	819,105.00	0.01
1,063	688466	金科环境	45,385	805,583.75	0.01
1,064	002236	大华股份	43,600	804,420.00	0.01
1,065	300318	博晖创新	128,800	803,712.00	0.01
1,066	300069	金利华电	49,700	800,170.00	0.01
1,067	300317	珈伟新能	155,200	789,968.00	0.01
1,068	300768	迪普科技	53,400	789,252.00	0.01
1,069	601963	重庆银行	110,900	771,864.00	0.01
1,070	300016	北陆药业	108,000	768,960.00	0.01
1,071	000782	美达股份	139,500	765,855.00	0.01

1,072	603987	康德莱	78,400	747,936.00	0.01
1,073	603759	海天股份	89,372	742,681.32	0.01
1,074	688306	均普智能	132,935	740,447.95	0.01
1,075	300157	恒泰艾普	211,700	734,599.00	0.01
1,076	300767	震安科技	42,200	733,436.00	0.01
1,077	002367	康力电梯	97,300	731,696.00	0.01
1,078	300048	合康新能	143,200	724,592.00	0.01
1,079	002378	章源钨业	127,900	723,914.00	0.01
1,080	000407	胜利股份	198,400	718,208.00	0.01
1,081	300559	佳发教育	46,300	717,650.00	0.01
1,082	002524	光正眼科	109,300	704,985.00	0.01
1,083	603903	中持股份	70,700	698,516.00	0.01
1,084	002480	新筑股份	137,700	696,762.00	0.01
1,085	300991	创益通	39,900	693,462.00	0.01
1,086	300263	隆华科技	98,300	692,032.00	0.01
1,087	688579	山大地纬	54,096	687,019.20	0.01
1,088	301130	西点药业	24,500	683,060.00	0.01
1,089	301378	通达海	13,700	668,834.00	0.01
1,090	300867	圣元环保	41,900	668,305.00	0.01
1,091	603499	翔港科技	62,000	667,120.00	0.01
1,092	301185	鸥玛软件	31,800	647,448.00	0.01
1,093	688193	仁度生物	14,248	642,869.76	0.01
1,094	002090	金智科技	63,500	633,730.00	0.01
1,095	603611	诺力股份	33,000	624,690.00	0.01
1,096	601368	绿城水务	115,000	615,250.00	0.01
1,097	301019	宁波色母	25,500	612,765.00	0.01
1,098	300242	佳云科技	150,200	593,290.00	0.01
1,099	301157	华塑科技	13,800	590,640.00	0.01
1,100	002231	奥维通信	89,700	585,741.00	0.01
1,101	300804	广康生化	18,700	577,082.00	0.01
1,102	002263	大东南	228,800	576,576.00	0.01
1,103	301303	真兰仪表	28,623	563,586.87	0.01
1,104	601318	中国平安	13,600	548,080.00	0.01
1,105	002687	乔治白	101,900	543,127.00	0.01
1,106	600292	远达环保	89,400	542,658.00	0.01
1,107	603817	海峡环保	85,000	542,300.00	0.01
1,108	300813	泰林生物	21,800	534,536.00	0.01
1,109	002630	华西能源	214,900	532,952.00	0.01
1,110	002825	纳尔股份	62,100	529,713.00	0.01
1,111	301209	联合化学	20,800	519,168.00	0.01
1,112	300417	南华仪器	41,300	518,315.00	0.01
1,113	688182	灿勤科技	29,111	517,593.58	0.01
1,114	300066	三川智慧	98,700	498,435.00	0.00

1, 115	603901	永创智能	41, 600	495, 040. 00	0. 00
1, 116	002999	天禾股份	65, 700	492, 750. 00	0. 00
1, 117	301317	鑫磊股份	25, 000	491, 500. 00	0. 00
1, 118	002772	众兴菌业	62, 200	490, 758. 00	0. 00
1, 119	002600	领益智造	70, 600	477, 256. 00	0. 00
1, 120	688265	南模生物	12, 363	475, 357. 35	0. 00
1, 121	300238	冠昊生物	34, 900	473, 244. 00	0. 00
1, 122	300959	线上线下	12, 200	439, 200. 00	0. 00
1, 123	002852	道道全	40, 200	434, 964. 00	0. 00
1, 124	603176	汇通集团	70, 300	434, 454. 00	0. 00
1, 125	600577	精达股份	104, 800	433, 872. 00	0. 00
1, 126	300872	天阳科技	31, 600	432, 288. 00	0. 00
1, 127	002909	集泰股份	56, 600	431, 858. 00	0. 00
1, 128	300970	华绿生物	25, 000	431, 500. 00	0. 00
1, 129	603258	电魂网络	18, 000	413, 640. 00	0. 00
1, 130	300816	艾可蓝	16, 600	409, 522. 00	0. 00
1, 131	300589	江龙船艇	28, 400	394, 192. 00	0. 00
1, 132	300102	乾照光电	53, 000	389, 550. 00	0. 00
1, 133	002778	中晟高科	25, 600	384, 512. 00	0. 00
1, 134	301068	大地海洋	12, 600	383, 040. 00	0. 00
1, 135	000659	珠海中富	157, 400	379, 334. 00	0. 00
1, 136	000836	富通信息	139, 200	373, 056. 00	0. 00
1, 137	000720	新能泰山	89, 500	370, 530. 00	0. 00
1, 138	002546	新联电子	73, 100	365, 500. 00	0. 00
1, 139	300575	中旗股份	46, 100	352, 204. 00	0. 00
1, 140	000761	本钢板材	97, 400	347, 718. 00	0. 00
1, 141	603908	牧高笛	9, 300	346, 053. 00	0. 00
1, 142	301287	康力源	9, 200	331, 568. 00	0. 00
1, 143	301233	盛帮股份	7, 300	324, 266. 00	0. 00
1, 144	688686	奥普特	2, 867	321, 104. 00	0. 00
1, 145	600955	维远股份	17, 300	310, 535. 00	0. 00
1, 146	688618	三旺通信	5, 175	303, 255. 00	0. 00
1, 147	603698	航天工程	20, 300	291, 711. 00	0. 00
1, 148	301373	凌玮科技	9, 400	278, 710. 00	0. 00
1, 149	300183	东软载波	18, 400	277, 656. 00	0. 00
1, 150	000703	恒逸石化	40, 200	270, 144. 00	0. 00
1, 151	000404	长虹华意	45, 100	265, 639. 00	0. 00
1, 152	688345	博力威	8, 271	260, 205. 66	0. 00
1, 153	301389	隆扬电子	13, 500	257, 580. 00	0. 00
1, 154	603367	辰欣药业	17, 587	257, 473. 68	0. 00
1, 155	605566	福莱茵特	10, 200	257, 040. 00	0. 00
1, 156	601968	宝钢包装	47, 500	243, 675. 00	0. 00
1, 157	300092	科新机电	17, 000	226, 440. 00	0. 00

1, 158	002390	信邦制药	51, 000	226, 440. 00	0. 00
1, 159	603739	蔚蓝生物	14, 780	224, 951. 60	0. 00
1, 160	605177	东亚药业	8, 100	214, 488. 00	0. 00
1, 161	688400	凌云光	7, 833	211, 491. 00	0. 00
1, 162	002017	东信和平	20, 200	210, 282. 00	0. 00
1, 163	301024	霍普股份	6, 900	209, 070. 00	0. 00
1, 164	000553	安道麦 A	29, 601	205, 430. 94	0. 00
1, 165	002802	洪汇新材	15, 700	201, 117. 00	0. 00
1, 166	002900	哈三联	14, 500	197, 925. 00	0. 00
1, 167	300433	蓝思科技	14, 900	196, 680. 00	0. 00
1, 168	603155	新亚强	7, 900	190, 469. 00	0. 00
1, 169	300996	普联软件	8, 300	190, 070. 00	0. 00
1, 170	301353	普莱得	5, 900	189, 390. 00	0. 00
1, 171	300219	鸿利智汇	22, 400	188, 608. 00	0. 00
1, 172	300350	华鹏飞	36, 400	186, 732. 00	0. 00
1, 173	002346	柘中股份	16, 600	185, 090. 00	0. 00
1, 174	002283	天润工业	30, 300	177, 255. 00	0. 00
1, 175	000561	烽火电子	21, 000	176, 400. 00	0. 00
1, 176	002973	侨银股份	16, 000	175, 520. 00	0. 00
1, 177	301199	迈赫股份	6, 500	170, 625. 00	0. 00
1, 178	000026	飞亚达	15, 100	165, 496. 00	0. 00
1, 179	002350	北京科锐	23, 500	158, 625. 00	0. 00
1, 180	002788	鹭燕医药	16, 600	149, 234. 00	0. 00
1, 181	002537	海联金汇	21, 900	145, 854. 00	0. 00
1, 182	002373	千方科技	13, 000	145, 730. 00	0. 00
1, 183	002623	亚玛顿	5, 000	133, 750. 00	0. 00
1, 184	001217	华尔泰	9, 400	132, 728. 00	0. 00
1, 185	301041	金百泽	4, 900	132, 398. 00	0. 00
1, 186	301290	东星医疗	4, 700	129, 673. 00	0. 00
1, 187	000551	创元科技	12, 300	128, 781. 00	0. 00
1, 188	002565	顺灏股份	37, 100	125, 769. 00	0. 00
1, 189	605050	福然德	10, 200	125, 766. 00	0. 00
1, 190	301115	建科股份	6, 900	123, 510. 00	0. 00
1, 191	002762	金发拉比	13, 500	121, 230. 00	0. 00
1, 192	001212	中旗新材	5, 100	121, 176. 00	0. 00
1, 193	300055	万邦达	19, 500	120, 315. 00	0. 00
1, 194	001267	汇绿生态	22, 200	116, 106. 00	0. 00
1, 195	301057	汇隆新材	6, 600	110, 880. 00	0. 00
1, 196	000030	富奥股份	20, 700	110, 538. 00	0. 00
1, 197	300513	恒实科技	8, 900	105, 732. 00	0. 00
1, 198	002067	景兴纸业	27, 800	94, 242. 00	0. 00
1, 199	600058	五矿发展	9, 700	90, 986. 00	0. 00
1, 200	000789	万年青	12, 600	86, 436. 00	0. 00

1,201	301125	腾亚精工	4,500	85,140.00	0.00
1,202	300508	维宏股份	3,000	84,900.00	0.00
1,203	000636	风华高科	6,000	81,960.00	0.00
1,204	002010	传化智联	16,500	76,230.00	0.00
1,205	300473	德尔股份	3,600	65,808.00	0.00
1,206	605055	迎丰股份	9,100	65,065.00	0.00
1,207	300561	汇金科技	5,400	63,720.00	0.00
1,208	600966	博汇纸业	10,200	63,342.00	0.00
1,209	301319	唯特偶	900	52,569.00	0.00
1,210	688665	四方光电	635	46,837.60	0.00
1,211	002780	三夫户外	3,200	40,032.00	0.00
1,212	002898	赛隆药业	2,800	39,116.00	0.00
1,213	002679	福建金森	2,500	30,825.00	0.00
1,214	603900	莱绅通灵	2,200	14,696.00	0.00
1,215	300378	鼎捷软件	400	8,524.00	0.00
1,216	600617	国新能源	1,700	6,562.00	0.00
1,217	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
1,218	600321	正源股份	2,200	3,938.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	203,004,639.02	9.24
2	601688	华泰证券	179,395,697.04	8.16
3	600028	中国石化	163,285,304.00	7.43
4	601668	中国建筑	150,872,810.81	6.86
5	600030	中信证券	119,543,043.10	5.44
6	601186	中国铁建	117,020,085.00	5.32
7	601288	农业银行	116,941,498.00	5.32
8	600837	海通证券	113,349,831.80	5.16
9	600958	东方证券	106,530,850.94	4.85
10	601319	中国人保	105,613,663.56	4.81
11	600050	中国联通	105,566,873.50	4.80
12	002230	科大讯飞	104,255,096.03	4.74
13	300033	同花顺	103,889,626.75	4.73
14	600519	贵州茅台	102,629,772.32	4.67
15	300750	宁德时代	100,542,499.00	4.57
16	601211	国泰君安	96,102,256.00	4.37
17	601601	中国太保	95,432,070.00	4.34
18	002463	沪电股份	87,309,094.50	3.97
19	601398	工商银行	83,517,195.00	3.80
20	600019	宝钢股份	82,298,939.20	3.74

21	601088	中国神华	82,264,531.04	3.74
22	000166	申万宏源	79,221,483.38	3.60
23	000002	万 科 A	78,204,873.80	3.56
24	002304	洋河股份	74,367,496.47	3.38
25	601138	工业富联	72,216,476.54	3.29
26	601669	中国电建	71,748,808.00	3.26
27	600999	招商证券	70,017,484.88	3.19
28	601336	新华保险	69,960,105.10	3.18
29	002736	国信证券	69,918,803.20	3.18
30	300308	中际旭创	69,300,835.32	3.15
31	002466	天齐锂业	68,422,578.62	3.11
32	600061	国投资本	67,369,080.48	3.07
33	600390	五矿资本	66,849,245.00	3.04
34	000932	华菱钢铁	66,616,726.40	3.03
35	601618	中国中冶	66,012,182.61	3.00
36	601989	中国重工	64,419,361.00	2.93
37	601377	兴业证券	64,182,533.94	2.92
38	601800	中国交建	64,065,233.75	2.91
39	601108	财通证券	63,754,284.50	2.90
40	600023	浙能电力	63,726,245.00	2.90
41	601166	兴业银行	63,700,756.00	2.90
42	600016	民生银行	63,578,489.00	2.89
43	601658	邮储银行	63,122,684.67	2.87
44	601857	中国石油	62,062,044.98	2.82
45	600036	招商银行	61,881,117.27	2.82
46	000858	五 粮 液	61,868,350.58	2.81
47	000783	长江证券	61,709,238.28	2.81
48	000988	华工科技	61,332,250.84	2.79
49	603936	博敏电子	61,234,112.76	2.79
50	600362	江西铜业	58,551,496.71	2.66
51	600104	上汽集团	58,187,746.25	2.65
52	600171	上海贝岭	56,529,897.82	2.57
53	002673	西部证券	55,804,060.69	2.54
54	002558	巨人网络	55,388,164.95	2.52
55	603533	掌阅科技	55,380,899.00	2.52
56	601728	中国电信	55,153,659.00	2.51
57	000878	云南铜业	54,728,708.04	2.49
58	601390	中国中铁	54,578,998.89	2.48
59	600797	浙大网新	54,169,952.00	2.46
60	000001	平安银行	54,154,521.00	2.46
61	601881	中国银河	54,090,699.32	2.46
62	601818	光大银行	53,802,408.00	2.45
63	000627	天茂集团	53,762,336.00	2.45

64	600584	长电科技	53,558,770.00	2.44
65	000895	双汇发展	53,511,558.00	2.43
66	002415	海康威视	53,469,223.25	2.43
67	002156	通富微电	53,464,980.99	2.43
68	600909	华安证券	52,591,646.00	2.39
69	600330	天通股份	52,580,168.00	2.39
70	601169	北京银行	52,525,768.84	2.39
71	600927	永安期货	52,394,432.53	2.38
72	002092	中泰化学	52,295,171.00	2.38
73	000750	国海证券	51,242,275.00	2.33
74	300624	万兴科技	50,618,866.00	2.30
75	000538	云南白药	50,506,792.60	2.30
76	601868	中国能建	50,096,153.00	2.28
77	600490	鹏欣资源	49,813,845.10	2.27
78	300494	盛天网络	49,432,957.40	2.25
79	600808	马钢股份	49,168,484.66	2.24
80	688538	和辉光电	48,485,450.17	2.21
81	002384	东山精密	48,425,418.00	2.20
82	000100	TCL 科技	48,334,339.00	2.20
83	601328	交通银行	48,298,815.40	2.20
84	600809	山西汾酒	48,277,960.18	2.20
85	600170	上海建工	47,597,309.81	2.17
86	600098	广州发展	47,263,347.00	2.15
87	600690	海尔智家	47,073,823.98	2.14
88	600569	安阳钢铁	46,625,965.00	2.12
89	600985	淮北矿业	46,245,007.72	2.10
90	000778	新兴铸管	46,123,038.81	2.10
91	603019	中科曙光	45,666,038.08	2.08
92	601555	东吴证券	45,218,830.80	2.06
93	300058	蓝色光标	44,652,045.00	2.03
94	600711	盛屯矿业	44,617,821.00	2.03
95	300502	新易盛	44,428,196.98	2.02
96	000090	天健集团	44,264,141.01	2.01
97	600782	新钢股份	44,152,902.00	2.01

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	208,981,335.15	9.51
2	601688	华泰证券	183,162,648.47	8.33
3	600028	中国石化	153,435,043.27	6.98
4	601668	中国建筑	148,042,179.39	6.74

5	600030	中信证券	119,723,039.30	5.45
6	601288	农业银行	118,974,807.03	5.41
7	600519	贵州茅台	116,724,954.00	5.31
8	601186	中国铁建	114,867,032.49	5.23
9	600837	海通证券	111,751,477.46	5.08
10	300750	宁德时代	110,699,712.92	5.04
11	300033	同花顺	106,866,592.81	4.86
12	600958	东方证券	105,148,594.70	4.78
13	600050	中国联通	105,094,099.50	4.78
14	002230	科大讯飞	99,524,166.37	4.53
15	601211	国泰君安	98,570,636.11	4.48
16	002463	沪电股份	97,524,691.53	4.44
17	601601	中国太保	85,294,728.00	3.88
18	601398	工商银行	85,081,056.00	3.87
19	000166	申万宏源	82,875,482.60	3.77
20	601088	中国神华	82,551,093.62	3.76
21	600019	宝钢股份	80,762,663.05	3.67
22	000002	万 科 A	78,831,156.71	3.59
23	002736	国信证券	73,019,482.93	3.32
24	601108	财通证券	71,161,835.59	3.24
25	601138	工业富联	71,072,596.00	3.23
26	000858	五 粮 液	70,579,300.93	3.21
27	600036	招商银行	70,206,175.00	3.19
28	600999	招商证券	70,111,491.12	3.19
29	600061	国投资本	69,017,783.85	3.14
30	002304	洋河股份	68,340,637.00	3.11
31	300308	中际旭创	67,640,849.05	3.08
32	601669	中国电建	67,134,185.00	3.05
33	601658	邮储银行	65,756,270.55	2.99
34	600023	浙能电力	64,989,846.53	2.96
35	002466	天齐锂业	63,994,387.80	2.91
36	601989	中国重工	63,248,336.12	2.88
37	601377	兴业证券	62,988,090.34	2.87
38	601166	兴业银行	62,178,973.60	2.83
39	601336	新华保险	61,873,491.46	2.82
40	000932	华菱钢铁	61,724,950.02	2.81
41	600016	民生银行	61,639,614.00	2.80
42	600390	五矿资本	61,108,108.79	2.78
43	601618	中国中冶	60,403,049.00	2.75
44	601857	中国石油	59,783,623.46	2.72
45	601881	中国银河	58,746,027.06	2.67
46	000988	华工科技	57,767,260.78	2.63
47	601800	中国交建	57,069,339.10	2.60

48	002673	西部证券	54,999,687.10	2.50
49	002558	巨人网络	54,480,358.00	2.48
50	600909	华安证券	54,380,744.59	2.47
51	600809	山西汾酒	54,168,314.30	2.46
52	002156	通富微电	53,830,636.76	2.45
53	600362	江西铜业	53,555,786.12	2.44
54	600797	浙大网新	53,522,582.87	2.44
55	601818	光大银行	53,489,423.00	2.43
56	000895	双汇发展	53,018,797.00	2.41
57	600104	上汽集团	52,480,913.08	2.39
58	601169	北京银行	51,656,811.00	2.35
59	000728	国元证券	51,570,242.70	2.35
60	000001	平安银行	51,541,762.65	2.34
61	601555	东吴证券	51,519,027.70	2.34
62	601390	中国中铁	51,395,757.68	2.34
63	002415	海康威视	51,322,337.72	2.34
64	000878	云南铜业	50,454,142.75	2.30
65	000750	国海证券	50,076,078.11	2.28
66	600985	淮北矿业	50,027,041.24	2.28
67	601328	交通银行	49,599,059.50	2.26
68	601868	中国能建	48,590,599.20	2.21
69	000538	云南白药	48,243,071.84	2.19
70	000778	新兴铸管	48,156,474.20	2.19
71	601198	东兴证券	47,601,728.85	2.17
72	600170	上海建工	47,385,139.00	2.16
73	002384	东山精密	46,852,895.65	2.13
74	601901	方正证券	46,560,484.61	2.12
75	300624	万兴科技	46,291,103.00	2.11
76	600584	长电科技	46,002,052.69	2.09
77	000100	TCL 科技	45,765,529.73	2.08
78	600690	海尔智家	45,637,130.65	2.08
79	603019	中科曙光	45,543,184.98	2.07
80	300494	盛天网络	45,519,279.80	2.07
81	300058	蓝色光标	45,100,623.01	2.05
82	603533	掌阅科技	44,874,046.20	2.04
83	601888	中国中免	44,576,000.00	2.03
84	600098	广州发展	44,551,694.86	2.03
85	300131	英唐智控	44,442,488.85	2.02

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	50,072,013,772.19
卖出股票收入（成交）总额	42,991,302,810.08

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	281,627,972.61	2.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	281,627,972.61	2.76

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019709	23 国债 16	1,500,000	150,784,931.51	1.48
2	019727	23 国债 24	1,300,000	130,843,041.10	1.28

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,881,490.85
2	应收清算款	84,048,991.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,136,926.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,067,409.42

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国金量化	211,696	13,733.26	1,117,883,706.31	38.45	1,789,392,239.82	61.55

多因子 A						
国金量化多因子 C	70,869	27,765.04	1,119,109,816.66	56.87	848,570,703.73	43.13
合计	282,565	17,252.51	2,236,993,522.97	45.89	2,637,962,943.55	54.11

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金量化多因子 A	2,424,598.59	0.0834
	国金量化多因子 C	525,687.24	0.0267
	合计	2,950,285.83	0.0605

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金量化多因子 A	>100
	国金量化多因子 C	0~10
	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	50~100
	国金量化多因子 C	0
	合计	50~100

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

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
基金合同生效日（2018 年 10 月 31 日）基金份额总额	249,293,966.03	-
本报告期期初基金份额总额	853,060,173.35	339,632,067.14

本报告期基金总申购份额	3,943,105,700.47	3,676,302,324.95
减：本报告期基金总赎回份额	1,888,889,927.69	2,048,253,871.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,907,275,946.13	1,967,680,520.39

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为 100,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	2	10,059,881,16.85	10.81	4,419,656.24	10.86	-
广发证券	2	8,848,620,486.91	9.51	3,879,472.33	9.54	-
山西证券	1	7,300,486,354.62	7.84	3,148,660.17	7.74	-
国泰君安证券	2	6,073,769,002.34	6.53	2,624,940.21	6.45	-
华泰证券	2	4,721,550,563.15	5.07	2,069,598.01	5.09	-
天风证券	1	4,721,337,466.16	5.07	2,057,966.04	5.06	-
国新证券	2	4,666,834,391.99	5.01	2,012,785.06	4.95	-
信达证券	1	4,363,929,439.99	4.69	1,910,093.70	4.70	-
长江证券	2	4,231,672,986.94	4.55	1,870,067.13	4.60	-
中信建投证券	2	3,811,868,373.89	4.10	1,688,294.92	4.15	-
兴业证券	1	3,198,730,576.84	3.44	1,403,667.17	3.45	-
第一创业证券	2	3,100,661,550.49	3.33	1,349,240.43	3.32	-
西南证券	1	2,585,538,733.10	2.78	1,136,444.62	2.79	-
恒泰证券	1	2,371,361,010.83	2.55	1,034,099.40	2.54	-
国信证券	1	2,335,747,761.46	2.51	1,007,418.28	2.48	-
华西证券	1	2,242,328,353.92	2.41	999,868.86	2.46	-
英大证券	1	2,187,004,161.21	2.35	969,402.16	2.38	-
国投证券	1	2,107,508,516.49	2.26	927,303.20	2.28	-

华创证券	1	1,914,820,956.27	2.06	834,896.52	2.05	-
首创证券	1	1,847,745,440.73	1.99	804,252.91	1.98	-
东方财富证券	1	1,421,809,736.36	1.53	613,220.42	1.51	-
东北证券	1	1,416,777,842.70	1.52	611,070.49	1.50	-
中信证券	2	1,362,403,257.01	1.46	587,602.96	1.44	-
长城证券	1	1,171,031,360.40	1.26	505,068.72	1.24	-
东兴证券	1	1,022,679,665.91	1.10	446,583.58	1.10	-
中国中金财富证券	1	1,019,802,520.81	1.10	454,740.84	1.12	-
民生证券	1	775,039,800.16	0.83	345,594.97	0.85	-
国金证券股份有限公司	2	490,425,729.72	0.53	218,681.06	0.54	-
德邦证券	2	478,101,505.96	0.51	213,185.62	0.52	-
平安证券	2	471,685,691.07	0.51	210,331.60	0.52	-
华福证券	1	419,062,211.23	0.45	185,199.19	0.46	-
浙商证券	1	319,124,808.04	0.34	142,292.27	0.35	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-

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

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

- ①经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券

市场 研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；

⑤交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

②本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本基金本报告期新增国新证券、国金证券、华泰证券、方正证券、长江证券、国信证券、江海证券、华福证券、中信证券、华创证券、德邦证券、华西证券、首创证券、西南证券、民生证券、方正证券、平安证券、国投证券、中国中金财富证券、第一创业证券、东北证券、华泰证券、天风证券、中信建投证券、兴业证券、广发证券、浙商证券、恒泰证券共 36 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
招商证券	-	-	3,535,100,000.00	6.33	-	-
广发证券	-	-	3,141,333,000.00	5.62	-	-
山西证券	-	-	19,482,800,000.00	34.86	-	-
国泰君安证券	-	-	2,166,500,000.00	3.88	-	-
华泰证券	-	-	56,100,000.00	0.10	-	-
天风证券	-	-	7,246,000,000.00	12.97	-	-
国新证券	-	-	4,175,300,000.00	7.47	-	-
信达证券	-	-	2,909,600,000.00	5.21	-	-
长江证券	-	-	2,809,400,000.00	5.03	-	-
中信建投证券	19,971,947.95	7.12	1,908,800,000.00	3.42	-	-
兴业证券	-	-	2,161,200,000.00	3.87	-	-
第一创	-	-	593,300,000.00	1.06	-	-

业证券			00			
西南证 券	-	-	64,569,000.0 0	0.12	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	2,205,400,00 0.00	3.95	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	312,400,000. 00	0.56	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	2,740,000,00 0.00	4.90	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	101,522,000. 00	0.18	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	272,900,000. 00	0.49	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	260,340,296 .89	92.88	-	-	-	-

方正证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 05 日
2	《国金量化多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	2023 年 01 月 06 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 A 类份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 06 日
4	《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	2023 年 01 月 06 日
5	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
6	《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	2023 年 02 月 27 日
7	《国金量化多因子股票型证券投资基金（国金量化多因子 A 类份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 02 月 27 日
8	《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	2023 年 02 月 27 日
9	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 09 日
10	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金通过代销渠道申购（含转换转入、定期定额投资）限制金额的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 09 日
11	《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 10 日
12	《国金基金管理有限公司关于面向特定投资者（养老金客户）通过直销柜台申购（含转换转入）旗下基金实施费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 29 日
13	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2022 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 30 日
14	《国金基金管理有限公司关于公司系	指定披露媒体和本基金	2023 年 03 月 31 日

	统升级的公告》	基金管理人网站	
15	《关于调整国金量化多因子股票型证券投资基金单笔申购最低金额的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 20 日
16	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
17	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金通过代销渠道申购（含转换转入、定期定额投资）限制金额的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 05 月 25 日
18	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 16 日
19	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 07 月 21 日
20	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告更正公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 07 月 22 日
21	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 07 月 25 日
22	《国金基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 08 月 04 日
23	《国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 08 月 04 日
24	《国金量化多因子股票型证券投资基金托管协议》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 08 月 04 日
25	《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	2023 年 08 月 09 日
26	《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	2023 年 08 月 09 日
27	《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	2023 年 08 月 09 日
28	《关于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	2023 年 08 月 23 日
29	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年中期报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 08 月 30 日
30	《国金基金管理有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司投资者基金份额转托管的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 09 月 13 日
31	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 09 月 26 日
32	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 10 月 25 日

33	《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	2023 年 11 月 22 日
34	《国金基金管理有限公司关于旗下基金网上直销平台费率优惠活动结束的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 12 月 12 日
35	《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	2023 年 12 月 28 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日