

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 市场中性策略执行情况	67
7.13 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	69
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	72

§11 影响投资者决策的其他重要信息..... 74

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 74

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 74

§12 备查文件目录..... 75

12.1 备查文件目录..... 75

12.2 存放地点..... 75

12.3 查阅方式..... 75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国金量化多策略
场内简称	—
基金主代码	005443
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	172,305,204.74 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	—
上市日期	—

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	1、资产配置策略 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。 2、量化选股模型 （1）多因子选股策略 本基金股票部分的构建主要采用 Alpha 多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的大量因子信息，引入先进的因子筛选技术，动态捕捉市场热点，快速适应新的市场环境，对全市场股票进行筛选，增大组合的超市场收益。本基金在股票投资过程中，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产超越业绩基准的回报。 （2）统计套利策略 本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计工具找出市场内部个股之间的稳定性关系，将套利建立在对历史数据进行统计分析的基础之上，估计相关变量的概率分布进行套利操作。 （3）事件驱动套利策略

	本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的时间以及对过往事件的数据检测，获取时间影响所带来的超额投资回报。 （4）投资组合优化 本基金根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整个股权重，在控制风险的前提下追求收益最大化。 3、债券投资策略 债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。 （1）在债券投资方面，管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。 （2）可转债投资策略 本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，采用买入低转换溢价率的债券并持有的投资策略，密切关注可转换债券市场与股票市场之间的互动关系，选择恰当的时机进行套利，获得超额收益。 4、资产支持证券投资策略 资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 5、股指期货投资策略 本基金将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场进行量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资操作。 6、股票期权合约投资策略。 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。 基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。 7、国债期货投资策略
--	--

	国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现超额回报。 8、权证投资策略 本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。
业绩比较基准	$60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

注：无。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈广龙	石立平
	联系电话	010-88005888	010-63639180
	电子邮箱	chenguanglong@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100089	100033
法定代表人		尹庆军	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com

基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所
------------	------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际 财经中心 D 座 14 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,417,501.98
本期利润	-2,103,535.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0102
本期加权平均净值利润率	-1.27%
本期基金份额净值增长率	-0.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-35,310,641.20
期末可供分配基金份额利润	-0.2049
期末基金资产净值	141,968,734.79
期末基金份额净值	0.8239
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-17.61%

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

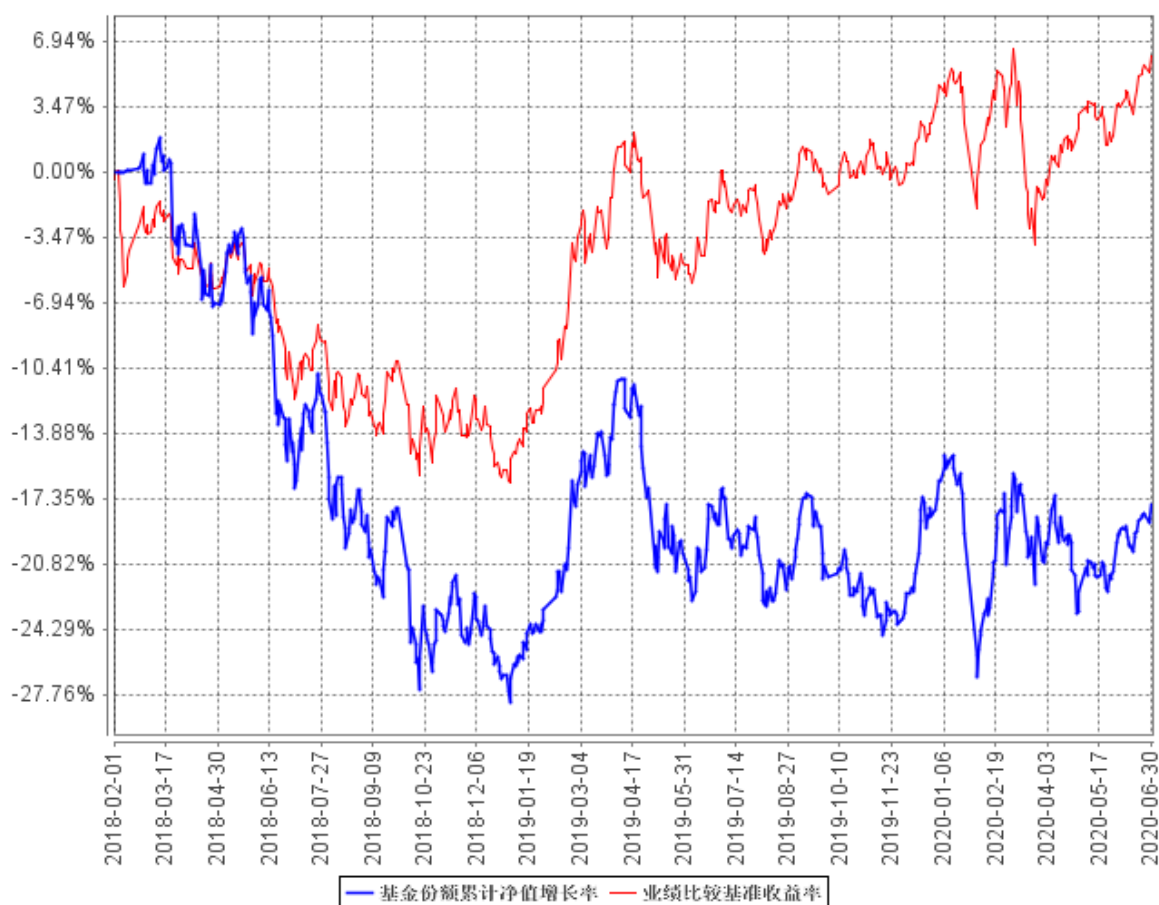
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.57%	0.65%	4.20%	0.53%	0.37%	0.12%
过去三个月	3.53%	0.90%	7.48%	0.54%	-3.95%	0.36%
过去六个月	-0.33%	1.37%	2.35%	0.90%	-2.68%	0.47%
过去一年	1.34%	1.13%	7.96%	0.72%	-6.62%	0.41%
自基金合同生效起至今	-17.61%	1.17%	6.17%	0.81%	-23.78%	0.36%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%

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

基金份额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



本基金基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2020年6月30日，国金基金管理有限公司共管理19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、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资基金、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）、国金及第七天理财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、国金民丰回报6个月定期开放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、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）、国金惠远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。

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		
杨雨龙	本基金基金经理，国金量化多因子、国金量化添利、国金鑫瑞灵活配置、国金民丰回报基金经理，量化投资事业二部总经理	2019年3月6日	2020年6月19日	11	杨雨龙先生，北京大学硕士。2007年7月至2009年9月在招商银行股份有限公司计划财务部任管理会计，2009年10月至2011年9月在博时基金管理有限公司交易部任股票交易员，2011年10月至2014年7月在兴业证券股份有限公司研究所任金融工程高级分析师，2014年7月至2017年6月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任量化投资部副总监、

					基金经理。2017 年 6 月加入国金基金管理有限公司，任量化投资事业二部总经理。
宫雪	本基金基金经理，国金鑫新灵活配置（LOF）、国金 300 指数增强、国金上证 50 指数增强（LOF）、国金鑫瑞灵活、国金红利增强、国金量化多因子、国金量化添利基金经理，创新投资部总经理	2020 年 6 月 10 日	-	12	宫雪女士，中国科学院博士。2008 年 7 月至 2011 年 12 月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012 年 2 月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理、量化投资事业部三部总经理兼产品中心代总经理；现任创新投资部总经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

期末不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金量化多策略灵活配置混合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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年市场风格主线是大盘蓝筹股弱于中小盘成长股，市场波动方面第二季度弱于第一季度。组合在分散投资、量化精选的基础上，运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，着重用量化的方法精选大盘蓝筹股。报告期内基本维持中高仓位运作，基本不进行大规模择时和加减仓。本基金自 6 月中下旬起对投资策略进行了调整，新策略以基本面因子为基础，利用机器学习方法构建多周期预测模型，通过预测因子和挖掘个股阿尔法等途径获取选股收益。2019 年，市场在一季度快速上涨后，在二季度开始回落。鉴于对后市的相对乐观，我们开始在二季度市场回调的过程中逐步增加仓位，目前维持中高仓位。选股策略方面，本基金运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，用量化的方法精选估值相对较低的价值白马股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8239 元；本报告期基金份额净值增长率为 -0.33%，业绩比较基准收益率为 2.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对宏观经济的总体判断如下：1) 货币政策方面会相对宽松；2) 权益市场估值水平在历史低位区间；3) 企业盈利处于触底阶段。另外，基建和制造业增速都处于底部，经济有望在今年

下半年逐步企稳。总体来说，权益市场具有一定投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定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。基金经理作为估值委员会的成员之一，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，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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合规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	45,648,162.06	19,469,442.55
结算备付金		3,154,727.01	12,040,988.72
存出保证金		140,538.06	188,607.66
交易性金融资产	6.4.7.2	132,481,675.97	175,884,675.38
其中：股票投资		131,289,910.97	175,144,621.78
基金投资		-	-
债券投资		1,191,765.00	740,053.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	14,850.46	47,159.25
应收股利		-	-
应收申购款		25,823.77	3,502.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		181,465,777.33	207,634,375.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		36,451,163.69	1,855,034.82
应付赎回款		1,073,943.85	2,217,202.18
应付管理人报酬		178,168.51	257,345.99
应付托管费		29,694.77	42,890.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,674,530.05	1,716,487.46
应交税费		0.34	0.35

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,541.33	280,634.36
负债合计		39,497,042.54	6,369,596.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	172,305,204.74	243,481,336.86
未分配利润	6.4.7.10	-30,336,469.95	-42,216,557.03
所有者权益合计		141,968,734.79	201,264,779.83
负债和所有者权益总计		181,465,777.33	207,634,375.98

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8239 元，基金份额总额 172,305,204.74 份。

6.2 利润表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		1,966,615.34	34,580,941.24
1.利息收入		138,761.71	343,845.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	135,489.60	244,780.55
债券利息收入		3,272.11	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	99,064.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,491,397.99	18,961,620.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	814,527.70	22,284,237.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-5,650,120.00
股利收益	6.4.7.16	676,870.29	2,327,502.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	313,966.38	15,255,186.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	22,489.26	20,289.21
减：二、费用		4,070,150.94	5,849,848.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,237,552.36	2,016,807.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	206,258.74	336,134.69

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,531,997.01	3,399,046.51
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.23	-
7. 其他费用	6.4.7.20	94,342.60	97,859.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,103,535.60	28,731,092.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,103,535.60	28,731,092.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	243,481,336.86	-42,216,557.03	201,264,779.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,103,535.60	-2,103,535.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-71,176,132.12	13,983,622.68	-57,192,509.44
其中：1.基金申购款	3,723,226.09	-772,147.11	2,951,078.98
2.基金赎回款	-74,899,358.21	14,755,769.79	-60,143,588.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	172,305,204.74	-30,336,469.95	141,968,734.79
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	351,563,915.66	-93,840,248.64	257,723,667.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,731,092.67	28,731,092.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-32,190,871.31	5,399,292.43	-26,791,578.88
其中：1.基金申购款	1,403,015.79	-242,138.49	1,160,877.30
2.基金赎回款	-33,593,887.10	5,641,430.92	-27,952,456.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	319,373,044.35	-59,709,863.54	259,663,180.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 尹庆军	_____ 聂武鹏	_____ 于晓莲
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1615 号文的核准，由国金基金管理有限公司于 2018 年 1 月 8 日至 2018 年 1 月 26 日向社会公开募集，基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效。首次募集规模为 425,485,490.92 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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批准发行上市的股票）、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 0-95%；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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

6.4.5 税项

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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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；

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。

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。

4. 个人所得税

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

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

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

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	45,648,162.06
定期存款	—
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	—
合计：	45,648,162.06

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,021,364.90	131,289,910.97	3,268,546.07
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	1,184,684.30	1,191,765.00
	银行间市场	—	—
	合计	1,184,684.30	1,191,765.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	129,206,049.20	132,481,675.97	3,275,626.77

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,655.56
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,016.54
应收债券利息	5,115.16
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	63.20
合计	14,850.46

6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,674,530.05
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,674,530.05

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	33.73
应付证券出借违约金	—

预提费用	89,507.60
合计	89,541.33

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	243,481,336.86	243,481,336.86
本期申购	3,723,226.09	3,723,226.09
本期赎回(以“-”号填列)	-74,899,358.21	-74,899,358.21
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	172,305,204.74	172,305,204.74

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-46,548,337.21	4,331,780.18	-42,216,557.03
本期利润	-2,417,501.98	313,966.38	-2,103,535.60
本期基金份额交易产生的变动数	13,655,197.99	328,424.69	13,983,622.68
其中：基金申购款	-697,926.17	-74,220.94	-772,147.11
基金赎回款	14,353,124.16	402,645.63	14,755,769.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35,310,641.20	4,974,171.25	-30,336,469.95

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	103,961.60
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	30,132.11

其他	1,395.89
合计	135,489.60

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	966,308,550.71
减：卖出股票成本总额	965,494,023.01
买卖股票差价收入	814,527.70

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益

6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期期间无衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	676,870.29
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	676,870.29

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	313,966.38
——股票投资	372,939.28
——债券投资	-58,972.90
——资产支持证券投资	-
——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	313,966.38

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	21,132.50
转出费收入	1,356.76
合计	22,489.26

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,531,997.01
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,531,997.01

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	335.00
中债债券账户维护费	4,500.00
合计	94,342.60

6.4.6.21 分部报告

无

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

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

本报告期未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国金证券	910,771,280.41	48.32%	1,058,105,389.53	42.13%

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
国金证券	-	-	88,000,000.00	14.52%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国金证券	666,048.09	47.93%	666,048.09	39.78%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国金证券	773,795.75	40.55%	1,626,436.15	62.55%

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,237,552.36	2,016,807.85
其中：支付销售机构的客	583,517.28	946,015.06

户维护费		
------	--	--

注：1. 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。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人于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基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	206,258.74	336,134.69

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.9.2.3 销售服务费

无

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.9.4.1 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**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.9.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.9.5.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行-活期存款	45,648,162.06	103,961.60	26,399,939.45	149,072.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息或约定利率计息。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

无

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.11 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
688158	优刻得	2020 年 1 月 10 日	2020 年 7 月 20 日	锁定期股票流通受限	33.23	68.38	6,900	229,287.00	471,822.00	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	16.42	16.42	2,436	39,999.12	39,999.12	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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、到期未能及时足额兑付本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级的债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	645,729.00	692,581.60
AAA 以下	45,036.00	47,472.00
未评级	—	—
合计	690,765.00	740,053.60

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

6.4.12.3.2 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求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流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整久期、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已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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.12.4 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等。

6.4.12.4.1 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。

本报告期内，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	45,648,162.06	-	-	-	-	-	45,648,162.06
结算备付金	3,154,727.01	-	-	-	-	-	3,154,727.01
存出保证金	140,538.06	-	-	-	-	-	140,538.06
交易性金融资产	-	-	1,191,765.00	-	-	131,289,910.97	132,481,675.97
应收利息	-	-	-	-	-	14,850.46	14,850.46
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	25,823.77	25,823.77
资产总计	48,943,427.13	-	1,191,765.00	-	-	131,330,585.20	181,465,777.33
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	36,451,163.69	36,451,163.69
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,073,943.85	1,073,943.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	178,168.51	178,168.51
应付托管费	-	-	-	-	-	29,694.77	29,694.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,674,530.05	1,674,530.05
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	-	89,541.33	89,541.33
负债总计	-	-	-	-	-	39,497,042.54	39,497,042.54
利率敏感度缺口	48,943,427.13	-	1,191,765.00	-	-	91,833,542.66	141,968,734.79
上年度末 2019 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							
银行存款	19,469,442.55	-	-	-	-	-	19,469,442.55
结算备付金	12,040,988.72	-	-	-	-	-	12,040,988.72
存出保证金	188,607.66	-	-	-	-	-	188,607.66
交易性金融资产	-	-	740,053.60	-	-	175,144,621.78	175,884,675.38
应收利息	-	-	-	-	-	47,159.25	47,159.25
应收申购款	-	-	-	-	-	3,502.42	3,502.42
资产总计	31,699,038.93	-	740,053.60	-	-	175,195,283.45	207,634,375.98
负债							
应付证券清算	-	-	-	-	-	1,855,034.82	1,855,034.82

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,217,202.18	2,217,202.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	257,345.99	257,345.99
应付托管费	-	-	-	-	-	42,890.99	42,890.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,716,487.46	1,716,487.46
应交税费	-	-	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	-	-	280,634.36	280,634.36
负债总计	-	-	-	-	-	6,369,596.15	6,369,596.15
利率敏感度缺口	31,699,038.93	-	740,053.60	-	-	-168,825,687.30	201,264,779.83

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或到期日孰早者进行分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末仅持有少量可转债及国债，未持有其他交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.4.2 外汇风险

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

6.4.12.4.3 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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产—股票投资	131,289,910.97	92.48	175,144,621.78	87.02
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,191,765.00	0.84	740,053.60	0.37
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	132,481,675.97	93.32	175,884,675.38	87.39

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数（000300.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沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	5%	5,393,252.03	7,726,301.31
	-5%	-5,393,252.03	-7,726,301.31

6.4.12.4.4 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。			
假设	1. 置信区间 —		
	2. 观察期 —		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	—	—	—
	合计	—	—

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	131,289,910.97	72.35
	其中：股票	131,289,910.97	72.35
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,191,765.00	0.66
	其中：债券	1,191,765.00	0.66
	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	48,802,889.07	26.89
8	其他各项资产	181,212.29	0.10
9	合计	181,465,777.33	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	76,153.00	0.05
B	采矿业	2,037,054.00	1.43
C	制造业	82,202,283.65	57.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,999,504.90	2.11
E	建筑业	920,245.40	0.65
F	批发和零售业	2,663,335.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	1,674,590.00	1.18
H	住宿和餐饮业	69,888.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,334,097.03	7.98
J	金融业	16,179,146.08	11.40
K	房地产业	2,222,511.52	1.57
L	租赁和商务服务业	998,707.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	2,915,589.92	2.05
N	水利、环境和公共设施管理业	1,624,453.07	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	1,086,298.40	0.77

P	教育	155,400.00	0.11
Q	卫生和社会工作	510,260.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	1,248,182.00	0.88
S	综合	372,212.00	0.26
	合计	131,289,910.97	92.48

注：以上行业分类以 2020 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,500	6,582,960.00	4.64
2	601318	中国平安	85,400	6,097,560.00	4.30
3	600036	招商银行	88,800	2,994,336.00	2.11
4	000858	五粮液	12,200	2,087,664.00	1.47
5	002403	爱仕达	188,439	1,516,933.95	1.07
6	002922	伊戈尔	83,400	1,146,750.00	0.81
7	603637	镇海股份	81,172	1,125,043.92	0.79
8	600561	江西长运	241,800	1,121,952.00	0.79
9	002729	好利来	33,069	1,102,520.46	0.78
10	300736	百邦科技	103,952	1,086,298.40	0.77
11	600000	浦发银行	101,700	1,075,986.00	0.76
12	002724	海洋王	170,100	1,047,816.00	0.74
13	000502	绿景控股	151,224	1,004,127.36	0.71
14	002540	亚太科技	216,800	934,408.00	0.66
15	603677	奇精机械	81,617	841,471.27	0.59
16	300652	雷迪克	38,200	738,788.00	0.52
17	601601	中国太保	26,800	730,300.00	0.51
18	601211	国泰君安	39,100	674,866.00	0.48
19	300711	广哈通信	55,827	667,132.65	0.47
20	600719	大连热电	140,364	611,987.04	0.43
21	002608	江苏国信	93,938	591,809.40	0.42
22	002855	捷荣技术	55,882	586,202.18	0.41
23	600780	通宝能源	177,600	577,200.00	0.41
24	603586	金麒麟	30,435	483,003.45	0.34
25	300424	航新科技	35,600	476,328.00	0.34

26	688158	优刻得	6,900	471,822.00	0.33
27	600202	哈空调	107,487	443,921.31	0.31
28	300782	卓胜微	1,080	438,231.60	0.31
29	000619	海螺型材	91,167	437,601.60	0.31
30	300670	大烨智能	68,000	415,480.00	0.29
31	300750	宁德时代	2,300	401,028.00	0.28
32	000166	申万宏源	78,800	397,940.00	0.28
33	300136	信维通信	7,500	397,650.00	0.28
34	300508	维宏股份	16,594	397,094.42	0.28
35	300283	温州宏丰	95,944	395,289.28	0.28
36	002152	广电运通	29,800	385,612.00	0.27
37	600703	三安光电	15,200	380,000.00	0.27
38	002273	水晶光电	22,000	377,080.00	0.27
39	600410	华胜天成	27,500	374,000.00	0.26
40	300088	长信科技	33,300	372,960.00	0.26
41	300236	上海新阳	6,200	372,372.00	0.26
42	600536	中国软件	4,700	372,240.00	0.26
43	002463	沪电股份	14,900	372,202.00	0.26
44	300162	雷曼光电	54,750	371,205.00	0.26
45	002049	紫光国微	5,100	371,025.00	0.26
46	601012	隆基股份	9,100	370,643.00	0.26
47	601939	建设银行	58,700	370,397.00	0.26
48	603005	晶方科技	4,700	369,702.00	0.26
49	000100	TCL 科技	59,600	369,520.00	0.26
50	000063	中兴通讯	9,200	369,196.00	0.26
51	600030	中信证券	15,300	368,883.00	0.26
52	600183	生益科技	12,600	368,802.00	0.26
53	002131	利欧股份	95,300	367,858.00	0.26
54	300383	光环新网	14,100	367,587.00	0.26
55	300346	南大光电	8,300	357,896.00	0.25
56	601899	紫金矿业	81,300	357,720.00	0.25
57	601688	华泰证券	19,000	357,200.00	0.25
58	000021	深科技	15,800	344,914.00	0.24
59	300207	欣旺达	18,200	343,980.00	0.24
60	300450	先导智能	7,400	341,954.00	0.24
61	002075	沙钢股份	26,600	332,500.00	0.23
62	002481	双塔食品	18,900	327,348.00	0.23
63	000016	深康佳 A	47,700	322,452.00	0.23
64	601166	兴业银行	20,200	318,756.00	0.22

65	002602	世纪华通	20,800	318,448.00	0.22
66	002360	同德化工	63,600	317,364.00	0.22
67	002436	兴森科技	24,500	314,335.00	0.22
68	300437	清水源	30,000	309,000.00	0.22
69	603986	兆易创新	1,300	306,683.00	0.22
70	000158	常山北明	28,500	297,540.00	0.21
71	600958	东方证券	31,200	296,088.00	0.21
72	300015	爱尔眼科	6,800	295,460.00	0.21
73	600667	太极实业	24,700	291,954.00	0.21
74	002185	华天科技	21,500	290,895.00	0.20
75	603099	长白山	36,314	279,617.80	0.20
76	300115	长盈精密	12,100	276,485.00	0.19
77	002402	和而泰	16,900	273,949.00	0.19
78	600436	片仔癀	1,600	272,400.00	0.19
79	600837	海通证券	21,600	271,728.00	0.19
80	300014	亿纬锂能	5,600	267,960.00	0.19
81	002635	安洁科技	10,600	263,940.00	0.19
82	300316	晶盛机电	10,600	262,244.00	0.18
83	600360	华微电子	30,000	259,200.00	0.18
84	000988	华工科技	10,600	258,958.00	0.18
85	300342	天银机电	15,000	256,950.00	0.18
86	601901	方正证券	36,200	256,296.00	0.18
87	603168	莎普爱思	33,181	256,157.32	0.18
88	000818	航锦科技	11,000	245,630.00	0.17
89	603901	永创智能	34,400	244,928.00	0.17
90	600287	江苏舜天	43,200	237,168.00	0.17
91	600600	青岛啤酒	3,100	237,150.00	0.17
92	300046	台基股份	11,700	236,691.00	0.17
93	300373	扬杰科技	7,000	234,640.00	0.17
94	002980	华盛昌	3,600	228,816.00	0.16
95	300655	晶瑞股份	5,500	226,325.00	0.16
96	002938	鹏鼎控股	4,500	225,270.00	0.16
97	603000	人民网	11,300	224,079.00	0.16
98	300429	强力新材	12,500	223,500.00	0.16
99	603160	汇顶科技	1,000	222,900.00	0.16
100	002138	顺络电子	8,800	219,560.00	0.15
101	002023	海特高新	14,000	215,180.00	0.15
102	603882	金域医学	2,400	214,800.00	0.15
103	300118	东方日升	14,200	213,000.00	0.15

104	603259	药明康德	2,200	212,520.00	0.15
105	600641	万业企业	8,900	209,150.00	0.15
106	002036	联创电子	16,600	207,500.00	0.15
107	601231	环旭电子	9,500	207,480.00	0.15
108	300398	飞凯材料	9,800	206,976.00	0.15
109	600028	中国石化	52,800	206,448.00	0.15
110	300582	英飞特	14,643	203,098.41	0.14
111	002169	智光电气	20,700	203,067.00	0.14
112	603533	掌阅科技	5,300	202,089.00	0.14
113	603501	韦尔股份	1,000	201,950.00	0.14
114	002396	星网锐捷	5,700	201,381.00	0.14
115	603993	洛阳钼业	54,300	199,281.00	0.14
116	002056	横店东磁	17,700	199,125.00	0.14
117	002194	武汉凡谷	9,600	198,720.00	0.14
118	300379	东方通	4,600	197,938.00	0.14
119	002429	兆驰股份	39,700	196,515.00	0.14
120	300182	捷成股份	49,200	196,308.00	0.14
121	300456	赛微电子	7,100	196,102.00	0.14
122	300166	东方国信	15,800	196,078.00	0.14
123	002683	宏大爆破	5,600	195,440.00	0.14
124	002079	苏州固锝	14,500	190,965.00	0.13
125	002340	格林美	38,100	189,357.00	0.13
126	002104	恒宝股份	22,000	187,220.00	0.13
127	300063	天龙集团	27,700	186,698.00	0.13
128	600918	中泰证券	14,487	186,013.08	0.13
129	300001	特锐德	8,800	184,272.00	0.13
130	601689	拓普集团	6,600	184,140.00	0.13
131	300495	美尚生态	19,300	183,736.00	0.13
132	002497	雅化集团	19,800	182,754.00	0.13
133	300308	中际旭创	2,900	182,700.00	0.13
134	603858	步长制药	6,300	181,755.00	0.13
135	300457	赢合科技	5,700	181,716.00	0.13
136	000333	美的集团	3,000	179,370.00	0.13
137	603127	昭衍新药	1,700	178,721.00	0.13
138	603589	口子窖	3,500	178,150.00	0.13
139	300390	天华超净	12,700	176,911.00	0.12
140	300070	碧水源	21,700	176,204.00	0.12
141	300706	阿石创	5,100	175,236.00	0.12
142	300242	佳云科技	26,300	174,632.00	0.12

143	300202	聚龙股份	16,100	173,075.00	0.12
144	300184	力源信息	26,900	171,084.00	0.12
145	601878	浙商证券	17,200	170,452.00	0.12
146	300773	拉卡拉	4,900	170,373.00	0.12
147	600176	中国巨石	18,400	168,360.00	0.12
148	000049	德赛电池	3,400	166,634.00	0.12
149	000001	平安银行	13,000	166,400.00	0.12
149	603236	移远通信	800	166,400.00	0.12
150	002421	达实智能	42,800	166,064.00	0.12
151	002261	拓维信息	20,300	165,648.00	0.12
152	000555	神州信息	10,700	164,566.00	0.12
153	300709	精研科技	1,700	163,455.00	0.12
154	002183	怡亚通	30,400	162,944.00	0.11
155	603605	珀莱雅	900	162,018.00	0.11
156	002739	万达电影	10,600	161,862.00	0.11
157	300474	景嘉微	2,400	161,520.00	0.11
158	002449	国星光电	13,900	161,240.00	0.11
159	300476	胜宏科技	6,700	161,135.00	0.11
160	002648	卫星石化	9,900	161,073.00	0.11
161	300048	合康新能	42,400	160,696.00	0.11
162	600885	宏发股份	4,000	160,480.00	0.11
163	002063	远光软件	12,700	160,401.00	0.11
164	600580	卧龙电驱	14,200	159,608.00	0.11
165	002926	华西证券	14,900	158,387.00	0.11
166	002048	宁波华翔	10,200	157,488.00	0.11
167	600546	山煤国际	13,400	157,450.00	0.11
168	002013	中航机电	19,900	157,210.00	0.11
169	300792	壹网壹创	900	156,744.00	0.11
170	300357	我武生物	2,500	155,625.00	0.11
171	002607	中公教育	5,600	155,400.00	0.11
172	600503	华丽家族	35,200	155,232.00	0.11
173	000681	视觉中国	8,300	154,546.00	0.11
174	300303	聚飞光电	26,200	154,318.00	0.11
174	603233	大参林	1,900	154,318.00	0.11
175	300319	麦捷科技	13,800	153,318.00	0.11
176	601519	大智慧	18,900	152,334.00	0.11
177	002709	天赐材料	4,500	152,055.00	0.11
178	603888	新华网	6,800	152,048.00	0.11
179	300832	新产业	882	151,871.58	0.11

180	300598	诚迈科技	800	151,520.00	0.11
181	600893	航发动力	6,400	150,272.00	0.11
182	300078	思创医惠	11,100	150,183.00	0.11
183	002745	木林森	9,700	149,477.00	0.11
184	300263	隆华科技	18,700	149,039.00	0.10
185	603890	春秋电子	8,200	147,354.00	0.10
186	601377	兴业证券	21,500	147,275.00	0.10
187	300287	飞利信	35,300	146,495.00	0.10
188	300685	艾德生物	1,900	146,224.00	0.10
189	600132	重庆啤酒	2,000	146,000.00	0.10
190	300740	御家汇	10,600	145,856.00	0.10
191	601099	太平洋	45,700	144,869.00	0.10
192	300604	长川科技	4,700	144,713.00	0.10
193	000710	贝瑞基因	2,400	143,376.00	0.10
194	300590	移为通信	4,400	143,264.00	0.10
195	600535	天士力	8,800	142,736.00	0.10
196	000810	创维数字	11,800	142,544.00	0.10
197	300296	利亚德	23,400	142,038.00	0.10
198	002153	石基信息	3,600	140,508.00	0.10
199	600316	洪都航空	8,800	139,040.00	0.10
200	300036	超图软件	5,500	138,490.00	0.10
201	300077	国民技术	18,800	137,052.00	0.10
202	002897	意华股份	4,000	137,000.00	0.10
203	300188	美亚柏科	6,900	136,827.00	0.10
204	300328	宜安科技	11,400	136,458.00	0.10
205	002353	杰瑞股份	4,400	136,400.00	0.10
206	002623	亚玛顿	3,100	135,811.00	0.10
207	002557	洽洽食品	2,500	135,475.00	0.10
208	600019	宝钢股份	29,700	135,432.00	0.10
209	002324	普利特	9,000	135,090.00	0.10
210	002530	金财互联	11,000	134,640.00	0.09
211	002235	安妮股份	16,500	134,475.00	0.09
212	000951	中国重汽	4,300	134,418.00	0.09
213	002916	深南电路	800	134,016.00	0.09
214	603317	天味食品	2,400	133,392.00	0.09
215	300634	彩讯股份	6,000	133,380.00	0.09
216	600966	博汇纸业	13,100	132,965.00	0.09
217	002364	中恒电气	9,800	132,790.00	0.09
218	002129	中环股份	5,900	132,514.00	0.09

219	600093	易见股份	11,300	132,436.00	0.09
220	002803	吉宏股份	5,300	132,182.00	0.09
221	000609	中迪投资	22,600	131,984.00	0.09
222	600362	江西铜业	9,800	131,908.00	0.09
223	002025	航天电器	3,600	131,688.00	0.09
224	002647	仁东控股	3,700	131,276.00	0.09
225	601198	东兴证券	12,000	130,800.00	0.09
226	002125	湘潭电化	14,400	130,752.00	0.09
227	000603	盛达资源	11,000	129,250.00	0.09
228	300783	三只松鼠	1,700	129,166.00	0.09
229	300735	光弘科技	7,000	129,150.00	0.09
230	603283	赛腾股份	2,400	129,120.00	0.09
231	603983	丸美股份	1,500	129,045.00	0.09
232	300203	聚光科技	7,700	128,821.00	0.09
233	600066	宇通客车	10,500	128,100.00	0.09
234	300438	鹏辉能源	7,300	127,385.00	0.09
235	300047	天源迪科	17,500	127,050.00	0.09
236	603489	八方股份	900	126,891.00	0.09
237	002545	东方铁塔	16,500	126,720.00	0.09
238	300769	德方纳米	1,300	126,594.00	0.09
239	300659	中孚信息	2,100	126,042.00	0.09
240	300226	上海钢联	1,600	125,760.00	0.09
241	600057	厦门象屿	22,800	124,944.00	0.09
242	300101	振芯科技	11,300	124,865.00	0.09
243	002294	信立泰	4,200	124,572.00	0.09
244	603186	华正新材	2,500	124,425.00	0.09
245	601838	成都银行	15,600	124,176.00	0.09
246	300322	硕贝德	7,200	123,408.00	0.09
247	300448	浩云科技	12,900	123,195.00	0.09
248	600732	爱旭股份	11,400	123,006.00	0.09
249	601718	际华集团	37,000	122,840.00	0.09
250	601225	陕西煤业	17,000	122,570.00	0.09
251	600150	中国船舶	7,000	122,080.00	0.09
252	300075	数字政通	9,200	121,900.00	0.09
253	002782	可立克	9,200	121,532.00	0.09
254	603363	傲农生物	5,200	121,524.00	0.09
255	002536	飞龙股份	18,600	121,272.00	0.09
256	603108	润达医疗	9,100	121,212.00	0.09
257	603577	汇金通	11,800	121,186.00	0.09

258	300331	苏大维格	4,000	121,160.00	0.09
259	603638	艾迪精密	2,300	120,520.00	0.08
260	002792	通宇通讯	4,900	120,442.00	0.08
261	603536	惠发食品	8,500	120,275.00	0.08
262	300134	大富科技	8,600	120,228.00	0.08
263	300294	博雅生物	3,200	119,968.00	0.08
264	300427	红相股份	7,200	119,952.00	0.08
265	603636	南威软件	9,900	119,790.00	0.08
266	300130	新国都	8,700	119,625.00	0.08
267	002901	大博医疗	1,000	119,290.00	0.08
268	300018	中元股份	20,600	119,274.00	0.08
269	002461	珠江啤酒	11,900	119,238.00	0.08
270	603799	华友钴业	3,050	118,523.00	0.08
271	002837	英维克	4,000	118,480.00	0.08
272	601727	上海电气	23,500	118,440.00	0.08
273	300579	数字认证	2,900	118,117.00	0.08
274	603867	新化股份	5,100	117,504.00	0.08
275	300133	华策影视	16,200	117,450.00	0.08
276	603043	广州酒家	3,600	117,072.00	0.08
277	002734	利民股份	7,800	116,766.00	0.08
278	600246	万通地产	13,800	115,782.00	0.08
279	600051	宁波联合	13,200	115,764.00	0.08
280	002777	久远银海	3,800	115,558.00	0.08
281	300200	高盟新材	7,200	115,416.00	0.08
282	603912	佳力图	5,400	115,128.00	0.08
283	002539	云图控股	16,600	114,540.00	0.08
284	603200	上海洗霸	2,800	114,492.00	0.08
285	300102	乾照光电	25,400	114,300.00	0.08
286	600466	蓝光发展	21,200	114,268.00	0.08
287	600583	海油工程	25,100	114,205.00	0.08
288	300229	拓尔思	9,900	113,652.00	0.08
289	300785	值得买	900	113,139.00	0.08
290	603313	梦百合	4,800	112,944.00	0.08
291	600718	东软集团	9,800	112,700.00	0.08
292	300232	洲明科技	13,900	112,451.00	0.08
293	300682	朗新科技	6,600	112,332.00	0.08
294	603012	创力集团	15,600	111,228.00	0.08
295	600594	益佰制药	16,000	111,200.00	0.08
296	601137	博威合金	7,100	111,044.00	0.08

297	300366	创意信息	12,200	111,020.00	0.08
298	300224	正海磁材	12,800	110,848.00	0.08
299	603936	博敏电子	7,500	110,775.00	0.08
300	300686	智动力	4,600	110,676.00	0.08
301	600538	国发股份	13,500	110,430.00	0.08
302	002597	金禾实业	4,800	110,256.00	0.08
303	600369	西南证券	24,000	110,160.00	0.08
304	603583	捷昌驱动	1,600	109,408.00	0.08
305	002375	亚厦股份	10,700	109,354.00	0.08
306	002518	科士达	8,800	109,120.00	0.08
307	300455	康拓红外	7,300	108,405.00	0.08
308	300657	弘信电子	5,400	108,378.00	0.08
309	603816	顾家家居	2,400	108,024.00	0.08
310	000426	兴业矿业	15,700	108,016.00	0.08
311	600850	华东电脑	4,400	107,844.00	0.08
312	600153	建发股份	13,300	107,730.00	0.08
313	002757	南兴股份	6,300	107,415.00	0.08
314	603588	高能环境	9,200	107,272.00	0.08
315	002815	崇达技术	5,300	107,219.00	0.08
316	002452	长高集团	16,000	107,200.00	0.08
317	603383	顶点软件	2,400	107,016.00	0.08
318	000960	锡业股份	12,500	107,000.00	0.08
319	002565	顺灏股份	21,000	106,680.00	0.08
320	002484	江海股份	11,500	106,605.00	0.08
321	300768	迪普科技	2,300	106,467.00	0.07
322	600188	兖州煤业	12,100	105,996.00	0.07
323	603859	能科股份	3,100	105,896.00	0.07
324	300726	宏达电子	3,800	105,678.00	0.07
325	300679	电连技术	3,300	105,534.00	0.07
326	603183	建研院	14,900	105,343.00	0.07
327	600025	华能水电	27,600	104,604.00	0.07
328	002097	山河智能	17,500	104,475.00	0.07
329	600875	东方电气	11,800	104,430.00	0.07
330	000682	东方电子	21,000	104,160.00	0.07
331	000030	富奥股份	16,300	104,157.00	0.07
332	002512	达华智能	20,600	104,030.00	0.07
333	002117	东港股份	9,200	103,776.00	0.07
334	002430	杭氧股份	7,300	103,660.00	0.07
335	002343	慈文传媒	11,900	103,292.00	0.07

336	603737	三棵树	1,120	103,286.40	0.07
337	000627	天茂集团	19,800	103,158.00	0.07
338	300523	辰安科技	2,200	103,048.00	0.07
339	600496	精工钢构	30,700	102,845.00	0.07
340	000563	陕国投 A	27,700	102,767.00	0.07
341	603927	中科软	1,700	102,748.00	0.07
342	300323	华灿光电	18,800	102,460.00	0.07
343	603328	依顿电子	9,800	102,214.00	0.07
344	600864	哈投股份	17,000	102,170.00	0.07
345	300420	五洋停车	17,700	102,129.00	0.07
346	300138	晨光生物	8,400	101,976.00	0.07
347	600586	金晶科技	27,400	101,928.00	0.07
348	600480	凌云股份	9,100	101,920.00	0.07
349	002139	拓邦股份	18,100	101,903.00	0.07
350	300559	佳发教育	4,800	101,856.00	0.07
351	300066	三川智慧	20,700	101,844.00	0.07
352	300643	万通智控	7,200	101,736.00	0.07
353	002349	精华制药	19,300	101,711.00	0.07
354	002965	祥鑫科技	2,600	101,530.00	0.07
355	603156	养元饮品	4,720	101,480.00	0.07
356	300149	量子生物	5,400	101,466.00	0.07
357	300787	海能实业	2,700	101,250.00	0.07
358	300596	利安隆	2,900	101,007.00	0.07
359	600285	羚锐制药	10,800	100,980.00	0.07
360	000921	海信家电	8,300	100,928.00	0.07
361	002973	侨银环保	4,300	100,792.00	0.07
362	603590	康辰药业	2,600	100,776.00	0.07
363	300378	鼎捷软件	7,400	100,640.00	0.07
364	000973	佛塑科技	21,600	100,224.00	0.07
365	300493	润欣科技	11,000	100,100.00	0.07
366	002218	拓日新能	27,400	100,010.00	0.07
367	002064	华峰氨纶	19,700	99,879.00	0.07
368	603220	中贝通信	5,700	99,750.00	0.07
369	002796	世嘉科技	4,700	99,405.00	0.07
370	603466	风语筑	5,100	99,297.00	0.07
371	601616	广电电气	31,300	99,221.00	0.07
372	300068	南都电源	9,300	99,138.00	0.07
373	300249	依米康	15,800	98,908.00	0.07
374	600560	金自天正	10,500	98,805.00	0.07

375	002531	天顺风能	16,500	98,670.00	0.07
376	600372	中航电子	7,400	98,568.00	0.07
377	600252	中恒集团	30,700	98,547.00	0.07
378	002840	华统股份	5,200	98,488.00	0.07
379	002852	道道全	6,800	98,056.00	0.07
380	300747	锐科激光	900	97,947.00	0.07
381	603496	恒为科技	4,400	97,900.00	0.07
382	600562	国睿科技	6,600	97,812.00	0.07
383	600688	上海石化	28,100	97,788.00	0.07
384	603988	中电电机	7,500	97,425.00	0.07
385	603208	江山欧派	1,000	97,400.00	0.07
386	603990	麦迪科技	1,900	97,261.00	0.07
387	601778	晶科科技	12,349	97,063.14	0.07
388	002935	天奥电子	4,100	97,006.00	0.07
389	600989	宝丰能源	11,500	96,830.00	0.07
390	600770	综艺股份	20,100	96,480.00	0.07
391	300510	金冠股份	21,900	96,360.00	0.07
392	002879	长缆科技	6,200	96,224.00	0.07
393	600170	上海建工	31,200	95,784.00	0.07
394	603989	艾华集团	3,300	95,766.00	0.07
395	300356	光一科技	17,100	95,760.00	0.07
396	300252	金信诺	10,000	95,700.00	0.07
397	002091	江苏国泰	15,800	95,590.00	0.07
398	603129	春风动力	1,400	95,494.00	0.07
399	002201	九鼎新材	7,100	95,282.00	0.07
400	002232	启明信息	9,700	95,157.00	0.07
401	603700	宁水集团	3,200	95,104.00	0.07
402	601595	上海电影	6,300	95,004.00	0.07
403	300798	锦鸡股份	6,900	94,875.00	0.07
404	603023	威帝股份	19,000	94,810.00	0.07
405	603158	腾龙股份	4,200	94,626.00	0.07
406	600756	浪潮软件	5,100	94,350.00	0.07
407	600517	国网英大	14,100	94,188.00	0.07
408	002017	东信和平	7,900	94,168.00	0.07
409	002891	中宠股份	2,300	94,024.00	0.07
410	300489	中飞股份	3,000	94,020.00	0.07
411	300081	恒信东方	11,000	93,720.00	0.07
412	603626	科森科技	7,700	93,555.00	0.07
413	603050	科林电气	8,100	93,393.00	0.07

414	600129	太极集团	6,600	93,324.00	0.07
415	603360	百傲化学	4,800	93,264.00	0.07
416	002136	安纳达	11,100	93,240.00	0.07
417	002799	环球印务	4,800	93,216.00	0.07
418	002242	九阳股份	2,500	93,175.00	0.07
419	002809	红墙股份	7,100	93,152.00	0.07
420	601512	中新集团	8,100	93,150.00	0.07
421	300125	聆达股份	6,400	92,800.00	0.07
422	300678	中科信息	4,400	92,752.00	0.07
423	601002	晋亿实业	17,100	92,682.00	0.07
424	002263	大东南	41,700	92,574.00	0.07
425	600479	千金药业	10,000	92,500.00	0.07
426	300259	新天科技	16,000	92,480.00	0.07
427	000815	美利云	13,700	92,475.00	0.07
428	600601	方正科技	28,100	92,449.00	0.07
429	300428	四通新材	6,100	92,232.00	0.06
430	600993	马应龙	3,800	92,150.00	0.06
431	603133	碳元科技	5,300	92,061.00	0.06
432	002177	御银股份	21,900	91,980.00	0.06
433	300080	易成新能	20,400	91,800.00	0.06
434	603660	苏州科达	10,000	91,700.00	0.06
435	300241	瑞丰光电	15,800	91,482.00	0.06
436	600835	上海机电	5,400	91,422.00	0.06
437	601330	绿色动力	9,600	91,200.00	0.06
438	600678	四川金顶	15,400	91,168.00	0.06
439	002434	万里扬	10,500	91,140.00	0.06
440	000925	众合科技	12,500	91,125.00	0.06
441	600482	中国动力	5,800	91,060.00	0.06
442	601366	利群股份	14,900	91,039.00	0.06
443	300513	恒实科技	7,100	90,951.00	0.06
444	300606	金太阳	4,400	90,904.00	0.06
445	002751	易尚展示	4,000	90,880.00	0.06
446	002358	森源电气	18,200	90,818.00	0.06
447	300530	达志科技	2,200	90,816.00	0.06
448	601311	骆驼股份	10,000	90,800.00	0.06
449	600158	中体产业	11,100	90,798.00	0.06
450	300771	智莱科技	2,400	90,720.00	0.06
450	603505	金石资源	4,200	90,720.00	0.06
451	603131	上海沪工	5,200	90,636.00	0.06

452	600933	爱柯迪	6,500	90,480.00	0.06
453	002910	庄园牧场	8,700	90,393.00	0.06
454	603256	宏和科技	7,900	90,376.00	0.06
455	603113	金能科技	7,600	90,364.00	0.06
456	002417	深南股份	13,700	90,283.00	0.06
457	601699	潞安环能	16,200	90,234.00	0.06
458	002339	积成电子	15,300	90,117.00	0.06
459	600602	云赛智联	12,400	90,024.00	0.06
460	600063	皖维高新	27,500	89,650.00	0.06
461	600448	华纺股份	22,900	89,539.00	0.06
462	300762	上海瀚讯	2,800	89,320.00	0.06
463	002519	银河电子	21,500	89,225.00	0.06
464	300190	维尔利	11,800	89,090.00	0.06
465	300423	鲁亿通	7,200	88,992.00	0.06
466	600829	人民同泰	12,000	88,920.00	0.06
467	600388	龙净环保	10,100	88,880.00	0.06
468	603938	三孚股份	3,600	88,704.00	0.06
469	600396	金山股份	37,100	88,669.00	0.06
470	300781	因赛集团	3,000	88,650.00	0.06
471	300409	道氏技术	7,900	88,638.00	0.06
472	600764	中国海防	3,500	88,550.00	0.06
473	603045	福达合金	6,400	88,512.00	0.06
474	600962	国投中鲁	10,100	88,274.00	0.06
475	603789	星光农机	6,600	88,242.00	0.06
476	600579	克劳斯	16,900	88,218.00	0.06
477	002808	恒久科技	9,600	88,128.00	0.06
478	603279	景津环保	4,300	88,107.00	0.06
479	002552	宝鼎科技	6,100	88,084.00	0.06
480	002213	特尔佳	4,900	87,955.00	0.06
481	002962	五方光电	3,600	87,948.00	0.06
482	600577	精达股份	31,600	87,848.00	0.06
483	300660	江苏雷利	5,000	87,700.00	0.06
484	002376	新北洋	8,600	87,634.00	0.06
485	002488	金固股份	16,500	87,450.00	0.06
486	603937	丽岛新材	5,800	87,290.00	0.06
487	002181	粤传媒	17,500	86,975.00	0.06
488	300099	精准信息	15,800	86,742.00	0.06
489	600277	亿利洁能	26,600	86,716.00	0.06
490	002636	金安国纪	9,500	86,545.00	0.06

491	300479	神思电子	5,600	86,240.00	0.06
492	300797	钢研纳克	5,800	85,898.00	0.06
493	603214	爱婴室	2,800	85,876.00	0.06
494	300414	中光防雷	7,600	85,728.00	0.06
495	600590	泰豪科技	15,900	85,701.00	0.06
496	300516	久之洋	2,800	85,624.00	0.06
497	600996	贵广网络	12,000	85,560.00	0.06
498	300395	菲利华	2,600	85,462.00	0.06
499	603030	全筑股份	12,000	85,440.00	0.06
500	603026	石大胜华	3,200	85,408.00	0.06
501	300808	久量股份	4,300	85,140.00	0.06
502	600901	江苏租赁	16,300	84,923.00	0.06
503	300800	力合科技	2,600	84,916.00	0.06
504	600284	浦东建设	13,800	84,870.00	0.06
505	300569	天能重工	10,400	84,864.00	0.06
506	000856	冀东装备	10,500	84,840.00	0.06
507	002952	亚世光电	4,800	84,768.00	0.06
508	000996	中国中期	9,800	84,672.00	0.06
509	603613	国联股份	900	84,600.00	0.06
510	300011	鼎汉技术	14,400	84,528.00	0.06
511	300506	名家汇	16,800	84,336.00	0.06
512	300752	隆利科技	3,100	84,227.00	0.06
513	300811	铂科新材	1,200	84,000.00	0.06
514	300266	兴源环境	25,600	83,968.00	0.06
515	300384	三联虹普	4,800	83,904.00	0.06
516	000553	安道麦 A	9,300	83,886.00	0.06
517	002712	思美传媒	12,000	83,880.00	0.06
518	300389	艾比森	8,500	83,810.00	0.06
519	603727	博迈科	4,700	83,425.00	0.06
520	002972	科安达	3,500	83,405.00	0.06
521	002892	科力尔	3,700	83,361.00	0.06
522	600642	申能股份	14,100	83,331.00	0.06
523	603579	荣泰健康	3,100	83,142.00	0.06
524	002441	众业达	10,400	83,096.00	0.06
525	002923	润都股份	4,000	83,040.00	0.06
525	300174	元力股份	4,800	83,040.00	0.06
526	600753	东方银星	8,200	82,984.00	0.06
527	603786	科博达	1,100	82,885.00	0.06
528	300023	宝德股份	7,600	82,840.00	0.06

529	600230	沧州大化	9,800	82,810.00	0.06
530	603096	新经典	1,400	82,642.00	0.06
531	002380	科远智慧	5,900	82,600.00	0.06
532	002877	智能自控	11,400	82,536.00	0.06
533	002231	奥维通信	12,200	82,472.00	0.06
534	300672	国科微	1,600	82,256.00	0.06
535	002783	凯龙股份	8,400	82,152.00	0.06
536	300155	安居宝	13,700	82,063.00	0.06
537	600657	信达地产	19,900	81,988.00	0.06
538	600825	新华传媒	13,200	81,972.00	0.06
539	603396	金辰股份	3,000	81,930.00	0.06
540	300351	永贵电器	9,400	81,874.00	0.06
541	002753	永东股份	8,800	81,840.00	0.06
542	603897	长城科技	4,200	81,816.00	0.06
543	002861	瀛通通讯	3,000	81,810.00	0.06
544	603326	我乐家居	4,200	81,732.00	0.06
545	300730	科创信息	6,400	81,536.00	0.06
546	603992	松霖科技	5,100	81,396.00	0.06
547	300597	吉大通信	7,300	81,395.00	0.06
548	300074	华平股份	18,400	81,328.00	0.06
549	600490	鹏欣资源	25,700	80,955.00	0.06
550	603421	鼎信通讯	5,400	80,892.00	0.06
551	300609	汇纳科技	2,200	80,740.00	0.06
552	603306	华懋科技	5,800	80,620.00	0.06
553	002469	三维工程	18,300	80,520.00	0.06
554	300593	新雷能	5,200	80,496.00	0.06
555	300320	海达股份	15,300	80,478.00	0.06
556	600548	深高速	8,800	80,432.00	0.06
557	002101	广东鸿图	11,700	80,379.00	0.06
558	002549	凯美特气	10,300	80,134.00	0.06
558	002843	泰嘉股份	10,300	80,134.00	0.06
559	300137	先河环保	12,000	80,040.00	0.06
560	300605	恒锋信息	6,100	80,032.00	0.06
561	600184	光电股份	8,300	80,012.00	0.06
562	300757	罗博特科	2,000	80,000.00	0.06
563	601001	大同煤业	20,400	79,968.00	0.06
564	600343	航天动力	10,300	79,928.00	0.06
565	002848	高斯贝尔	6,800	79,900.00	0.06
566	600526	菲达环保	16,200	79,866.00	0.06

567	600593	大连圣亚	1,900	79,857.00	0.06
568	601677	明泰铝业	9,200	79,856.00	0.06
569	603629	利通电子	3,200	79,776.00	0.06
570	002786	银宝山新	10,700	79,715.00	0.06
571	300065	海兰信	8,100	79,704.00	0.06
572	603380	易德龙	4,500	79,605.00	0.06
573	300648	星云股份	5,200	79,508.00	0.06
574	002199	东晶电子	9,800	79,478.00	0.06
575	603556	海兴电力	5,500	79,420.00	0.06
576	600229	城市传媒	10,700	79,394.00	0.06
577	300179	四方达	14,000	79,380.00	0.06
578	603166	福达股份	12,500	79,375.00	0.06
579	000720	新能泰山	15,800	79,316.00	0.06
580	601369	陕鼓动力	12,600	79,254.00	0.06
581	300786	国林科技	2,800	79,240.00	0.06
582	300731	科创新源	2,400	79,200.00	0.06
582	603959	百利科技	9,000	79,200.00	0.06
583	300208	青岛中程	12,600	79,128.00	0.06
584	002228	合兴包装	19,700	78,997.00	0.06
585	002546	新联电子	20,100	78,993.00	0.06
586	600683	京投发展	20,300	78,967.00	0.06
587	600768	宁波富邦	8,302	78,785.98	0.06
588	002749	国光股份	6,200	78,740.00	0.06
589	600308	华泰股份	17,100	78,660.00	0.06
590	300580	贝斯特	4,200	78,540.00	0.06
591	600676	交运股份	14,100	78,396.00	0.06
592	300515	三德科技	7,200	78,264.00	0.06
593	603803	瑞斯康达	6,700	78,256.00	0.06
594	000937	冀中能源	25,900	78,218.00	0.06
595	603978	深圳新星	3,800	78,204.00	0.06
596	603773	沃格光电	2,400	78,168.00	0.06
597	300120	经纬辉开	11,700	78,156.00	0.06
598	603527	众源新材	8,400	78,120.00	0.06
599	300371	汇中股份	5,600	77,952.00	0.05
600	603896	寿仙谷	2,300	77,924.00	0.05
601	000055	方大集团	17,800	77,786.00	0.05
602	002253	川大智胜	5,700	77,691.00	0.05
603	002325	洪涛股份	25,300	77,671.00	0.05
604	300403	汉宇集团	15,900	77,592.00	0.05

605	600616	金枫酒业	14,000	77,560.00	0.05
606	603203	快克股份	2,700	77,463.00	0.05
607	300214	日科化学	9,500	77,330.00	0.05
608	300264	佳创视讯	17,100	77,292.00	0.05
609	002453	华软科技	16,200	77,274.00	0.05
610	600976	健民集团	4,300	77,271.00	0.05
611	603357	设计总院	7,800	77,220.00	0.05
612	603828	柯利达	16,600	77,190.00	0.05
613	603351	威尔药业	3,300	77,088.00	0.05
614	300542	新晨科技	7,000	77,000.00	0.05
615	300239	东宝生物	17,200	76,884.00	0.05
616	300615	欣天科技	5,000	76,850.00	0.05
617	603017	中衡设计	7,300	76,796.00	0.05
618	603822	嘉澳环保	3,200	76,768.00	0.05
619	002738	中矿资源	5,100	76,449.00	0.05
620	601858	中国科传	8,500	76,415.00	0.05
621	600822	上海物贸	7,700	76,384.00	0.05
622	002816	和科达	2,300	76,360.00	0.05
623	002378	章源钨业	18,900	76,356.00	0.05
623	002721	金一文化	20,200	76,356.00	0.05
624	601158	重庆水务	15,300	76,347.00	0.05
625	002068	黑猫股份	18,000	76,320.00	0.05
626	600483	福能股份	10,500	76,230.00	0.05
627	002679	福建金森	7,700	76,153.00	0.05
628	002630	华西能源	37,500	76,125.00	0.05
629	601996	丰林集团	30,200	76,104.00	0.05
630	603709	中源家居	3,300	75,999.00	0.05
631	600995	文山电力	10,100	75,952.00	0.05
632	000007	全新好	8,700	75,951.00	0.05
633	002823	凯中精密	7,100	75,828.00	0.05
634	603716	塞力斯	5,200	75,712.00	0.05
635	300554	三超新材	4,900	75,656.00	0.05
636	300107	建新股份	13,800	75,624.00	0.05
637	601010	文峰股份	24,300	75,573.00	0.05
638	600985	淮北矿业	9,700	75,563.00	0.05
639	601882	海天精工	9,600	75,552.00	0.05
640	603486	科沃斯	2,500	75,525.00	0.05
641	000912	泸天化	18,600	75,516.00	0.05
642	300581	晨曦航空	5,200	75,504.00	0.05

643	600058	五矿发展	12,500	75,500.00	0.05
644	600355	精伦电子	26,100	75,429.00	0.05
645	600889	南京化纤	13,300	75,411.00	0.05
646	603192	汇得科技	2,900	75,400.00	0.05
647	603059	倍加洁	2,900	75,342.00	0.05
648	600098	广州发展	13,700	75,213.00	0.05
649	603339	四方科技	5,600	75,208.00	0.05
650	000423	东阿阿胶	2,100	75,201.00	0.05
651	002790	瑞尔特	12,300	75,153.00	0.05
652	002835	同为股份	6,700	75,040.00	0.05
653	603365	水星家纺	5,200	75,036.00	0.05
654	000828	东莞控股	10,700	74,900.00	0.05
655	600713	南京医药	17,200	74,820.00	0.05
656	002442	龙星化工	18,700	74,800.00	0.05
657	002871	伟隆股份	4,500	74,790.00	0.05
658	600798	宁波海运	25,600	74,752.00	0.05
659	000922	佳电股份	12,500	74,625.00	0.05
660	002140	东华科技	11,400	74,556.00	0.05
661	600481	双良节能	24,600	74,538.00	0.05
662	002211	宏达新材	12,800	74,496.00	0.05
663	002225	濮耐股份	17,600	74,448.00	0.05
664	600578	京能电力	25,400	74,422.00	0.05
665	600981	汇鸿集团	23,700	74,418.00	0.05
666	300057	万顺新材	15,600	74,412.00	0.05
667	002708	光洋股份	11,700	74,295.00	0.05
668	000726	鲁泰 A	9,800	74,284.00	0.05
669	603612	索通发展	6,500	74,230.00	0.05
670	603025	大豪科技	10,200	74,154.00	0.05
671	300350	华鹏飞	20,200	74,134.00	0.05
672	000633	合金投资	21,000	74,130.00	0.05
673	600620	天宸股份	12,600	74,088.00	0.05
674	603332	苏州龙杰	3,300	74,085.00	0.05
675	000622	恒立实业	19,800	74,052.00	0.05
676	000962	东方钽业	11,900	74,018.00	0.05
677	600851	海欣股份	9,900	73,953.00	0.05
678	002896	中大力德	3,200	73,920.00	0.05
679	300746	汉嘉设计	6,300	73,899.00	0.05
680	600858	银座股份	13,000	73,840.00	0.05
681	603967	中创物流	5,100	73,593.00	0.05

682	300304	云意电气	19,700	73,481.00	0.05
683	600156	华升股份	18,000	73,260.00	0.05
684	600227	圣济堂	27,200	73,168.00	0.05
685	603098	森特股份	8,100	73,143.00	0.05
686	603038	华立股份	4,700	73,132.00	0.05
687	000751	锌业股份	28,300	73,014.00	0.05
688	603499	翔港科技	4,200	72,996.00	0.05
689	603977	国泰集团	9,400	72,944.00	0.05
690	300445	康斯特	5,300	72,928.00	0.05
691	603311	金海环境	6,300	72,891.00	0.05
692	603386	广东骏亚	5,100	72,777.00	0.05
693	600152	维科技术	12,300	72,693.00	0.05
694	603926	铁流股份	6,300	72,639.00	0.05
695	300344	太空智造	18,100	72,581.00	0.05
696	002347	泰尔股份	17,400	72,558.00	0.05
697	601579	会稽山	8,700	72,384.00	0.05
698	002593	日上集团	21,100	72,373.00	0.05
699	002394	联发股份	8,100	72,090.00	0.05
700	300385	雪浪环境	11,300	71,981.00	0.05
701	002346	柘中股份	7,300	71,759.00	0.05
702	603809	豪能股份	5,400	71,658.00	0.05
703	000812	陕西金叶	25,200	71,568.00	0.05
704	002088	鲁阳节能	8,000	71,440.00	0.05
705	300610	晨化股份	5,800	71,340.00	0.05
706	600617	国新能源	18,200	71,162.00	0.05
707	300535	达威股份	5,800	71,050.00	0.05
708	603848	好太太	5,200	70,980.00	0.05
709	002900	哈三联	6,200	70,866.00	0.05
710	600292	远达环保	14,300	70,785.00	0.05
711	603578	三星新材	3,400	70,686.00	0.05
712	300710	万隆光电	2,800	70,672.00	0.05
713	603798	康普顿	7,100	70,645.00	0.05
714	000755	山西路桥	19,400	70,616.00	0.05
715	603757	大元泵业	4,400	70,488.00	0.05
716	300154	瑞凌股份	13,600	70,448.00	0.05
717	002598	山东章鼓	11,600	70,296.00	0.05
718	300588	熙菱信息	7,400	70,226.00	0.05
719	603817	海峡环保	11,600	70,180.00	0.05
720	600173	卧龙地产	15,000	70,050.00	0.05

721	603813	原尚股份	4,300	70,004.00	0.05
722	603227	雪峰科技	18,800	69,936.00	0.05
723	601007	金陵饭店	9,100	69,888.00	0.05
724	300689	澄天伟业	2,000	69,860.00	0.05
725	300129	泰胜风能	19,000	69,730.00	0.05
726	600784	鲁银投资	16,200	69,660.00	0.05
727	600101	明星电力	11,700	69,498.00	0.05
728	300321	同大股份	3,300	69,267.00	0.05
729	603963	大理药业	8,200	69,208.00	0.05
730	300543	朗科智能	4,900	69,139.00	0.05
731	603217	元利科技	2,500	69,125.00	0.05
732	300335	迪森股份	14,900	68,987.00	0.05
733	600082	海泰发展	20,500	68,880.00	0.05
734	600689	上海三毛	8,500	68,850.00	0.05
735	002248	华东数控	9,200	68,816.00	0.05
736	600099	林海股份	10,700	68,801.00	0.05
737	000993	闽东电力	11,800	68,794.00	0.05
738	002295	精艺股份	10,100	68,680.00	0.05
739	600722	金牛化工	20,600	68,598.00	0.05
740	300286	安科瑞	6,500	68,510.00	0.05
741	000565	渝三峡 A	14,600	68,328.00	0.05
742	600841	上柴股份	9,800	68,306.00	0.05
743	002730	电光科技	9,500	68,305.00	0.05
744	000430	张家界	14,600	68,182.00	0.05
745	603966	法兰泰克	6,900	68,172.00	0.05
746	002658	雪迪龙	11,400	67,944.00	0.05
747	300717	华信新材	4,500	67,410.00	0.05
748	300756	中山金马	3,100	66,960.00	0.05
749	002812	恩捷股份	1,000	65,800.00	0.05
750	002281	光迅科技	2,000	65,720.00	0.05
751	002912	中新赛克	400	65,436.00	0.05
752	300777	中简科技	1,800	65,160.00	0.05
753	000863	三湘印象	15,134	64,168.16	0.05
754	601827	三峰环境	6,723	63,801.27	0.04
755	300568	星源材质	3,400	63,308.00	0.04
756	603659	璞泰来	600	61,812.00	0.04
757	300170	汉得信息	6,400	61,568.00	0.04
758	300737	科顺股份	3,100	61,163.00	0.04
759	300695	兆丰股份	800	61,160.00	0.04

760	600629	华建集团	7,000	60,130.00	0.04
761	002027	分众传媒	10,700	59,599.00	0.04
762	600114	东睦股份	5,700	59,166.00	0.04
763	600803	新奥股份	5,700	58,938.00	0.04
764	603819	神力股份	5,460	57,876.00	0.04
765	002932	明德生物	900	57,519.00	0.04
766	002579	中京电子	4,000	57,200.00	0.04
767	002883	中设股份	2,300	56,580.00	0.04
768	002989	中天精装	980	55,056.40	0.04
769	002940	昂利康	1,000	54,140.00	0.04
770	002990	盛视科技	612	53,807.04	0.04
771	603037	凯众股份	3,200	53,344.00	0.04
772	300603	立昂技术	1,800	52,794.00	0.04
773	300250	初灵信息	3,900	51,246.00	0.04
774	603508	思维列控	1,500	50,460.00	0.04
775	603087	甘李药业	473	47,441.90	0.03
776	002791	坚朗五金	500	47,045.00	0.03
777	600262	北方股份	2,700	46,251.00	0.03
778	600876	洛阳玻璃	3,200	43,296.00	0.03
779	603110	东方材料	2,900	42,775.00	0.03
780	300831	派瑞股份	1,716	41,372.76	0.03
781	688377	迪威尔	2,436	39,999.12	0.03
782	300073	当升科技	1,200	39,684.00	0.03
783	600438	通威股份	2,200	38,236.00	0.03
784	002189	中光学	2,200	38,126.00	0.03
785	603665	康隆达	2,000	37,580.00	0.03
786	600493	凤竹纺织	7,600	37,392.00	0.03
787	300201	海伦哲	9,200	35,972.00	0.03
788	002887	绿茵生态	2,900	35,322.00	0.02
789	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.02
790	002831	裕同科技	1,200	33,012.00	0.02
791	002986	宇新股份	630	31,783.50	0.02
792	603516	淳中科技	800	30,544.00	0.02
793	600033	福建高速	11,300	29,945.00	0.02
794	002466	天齐锂业	1,200	27,540.00	0.02
795	603939	益丰药房	300	27,300.00	0.02
796	300531	优博讯	1,300	27,040.00	0.02
797	300617	安靠智电	800	26,880.00	0.02
798	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.02

799	603755	日辰股份	300	26,508.00	0.02
800	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.02
801	600452	涪陵电力	1,800	25,974.00	0.02
802	603950	长源东谷	1,081	25,716.99	0.02
803	603161	科华控股	1,700	23,970.00	0.02
804	603368	柳药股份	1,040	23,868.00	0.02
805	603823	百合花	1,400	23,520.00	0.02
806	603315	福鞍股份	1,800	23,508.00	0.02
807	603039	泛微网络	300	23,178.00	0.02
808	600928	西安银行	4,400	23,144.00	0.02
809	603768	常青股份	1,700	23,086.00	0.02
810	300838	浙江力诺	909	22,243.23	0.02
811	603679	华体科技	500	19,655.00	0.01
812	603610	麒盛科技	600	19,248.00	0.01
813	300551	古鳌科技	800	15,144.00	0.01
814	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
815	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
816	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
817	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
818	603909	合诚股份	400	6,108.00	0.00
819	600389	江山股份	300	5,487.00	0.00
820	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600908	无锡银行	16,492,091.65	8.19
2	002948	青岛银行	16,110,929.00	8.00
3	002839	张家港行	16,066,962.00	7.98
4	000617	中油资本	15,795,304.01	7.85
5	000890	*ST 胜尔	15,349,627.00	7.63
6	002936	郑州银行	14,585,985.00	7.25
7	002807	江阴银行	14,329,340.03	7.12
8	600928	西安银行	14,025,571.77	6.97
9	600365	通葡股份	10,111,937.00	5.02

10	300023	宝德股份	10,027,431.50	4.98
11	300176	派生科技	8,804,190.00	4.37
12	600599	*ST 熊猫	7,864,881.00	3.91
13	603323	苏农银行	7,833,725.86	3.89
14	601998	中信银行	7,495,479.00	3.72
15	603677	奇精机械	7,118,746.00	3.54
16	601318	中国平安	6,966,122.42	3.46
17	600318	新力金融	6,625,011.00	3.29
18	600189	吉林森工	6,435,972.00	3.20
19	601860	紫金银行	6,380,142.00	3.17
20	002719	*ST 麦趣	6,200,121.92	3.08
21	000416	民生控股	6,136,133.00	3.05
22	600519	贵州茅台	5,910,681.00	2.94
23	000666	经纬纺机	5,753,656.00	2.86
24	300272	开能健康	5,553,613.90	2.76
25	000929	兰州黄河	5,363,945.00	2.67
26	601128	常熟银行	5,318,044.00	2.64
27	600573	惠泉啤酒	5,016,120.00	2.49
28	600616	金枫酒业	4,817,577.00	2.39
29	002820	桂发祥	4,736,517.80	2.35
30	000502	绿景控股	4,679,243.00	2.32
31	002403	爱仕达	4,662,779.00	2.32
32	600638	新黄浦	4,604,653.30	2.29
33	002646	青青稞酒	4,601,344.00	2.29
34	600463	空港股份	4,487,648.39	2.23
35	603919	金徽酒	4,321,781.00	2.15
36	600543	莫高股份	4,269,484.00	2.12
37	000679	*ST 友谊	4,174,674.00	2.07

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000617	中油资本	24,945,151.86	12.39
2	600908	无锡银行	23,249,194.41	11.55

3	002807	江阴银行	21,689,473.77	10.78
4	300176	派生科技	18,617,545.74	9.25
5	300023	宝德股份	15,486,665.22	7.69
6	002839	张家港行	15,222,308.58	7.56
7	002948	青岛银行	14,893,240.84	7.40
8	601998	中信银行	14,604,212.56	7.26
9	002936	郑州银行	13,962,624.80	6.94
10	600928	西安银行	13,137,310.96	6.53
11	600830	香溢融通	13,116,444.69	6.52
12	000890	*ST 胜尔	12,196,256.79	6.06
13	600318	新力金融	11,524,464.70	5.73
14	600365	通葡股份	10,269,187.22	5.10
15	600599	*ST 熊猫	7,916,173.09	3.93
16	603323	苏农银行	7,752,349.20	3.85
17	601860	紫金银行	6,702,144.50	3.33
18	603677	奇精机械	6,323,854.99	3.14
19	601579	会稽山	6,260,085.07	3.11
20	000416	民生控股	5,958,290.08	2.96
21	600189	吉林森工	5,690,975.46	2.83
22	000666	经纬纺机	5,540,231.61	2.75
23	002719	*ST 麦趣	5,524,878.63	2.75
24	601128	常熟银行	5,391,086.24	2.68
25	002820	桂发祥	5,344,759.94	2.66
26	300272	开能健康	5,329,259.98	2.65
27	600573	惠泉啤酒	5,289,056.42	2.63
28	000929	兰州黄河	5,147,406.08	2.56
29	600616	金枫酒业	4,856,236.52	2.41
30	603919	金徽酒	4,817,620.77	2.39
31	600543	莫高股份	4,589,310.91	2.28
32	600463	空港股份	4,588,266.01	2.28
33	603637	镇海股份	4,559,383.42	2.27
34	002646	青青稞酒	4,438,279.07	2.21
35	600983	惠而浦	4,403,159.19	2.19
36	600638	新黄浦	4,195,911.58	2.08
37	002379	宏创控股	4,085,318.65	2.03

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	921,266,372.92
卖出股票收入（成交）总额	966,308,550.71

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	501,000.00	0.35
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）	690,765.00	0.49
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,191,765.00	0.84

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	6,340	645,729.00	0.45
2	019612	19 国债 02	5,000	501,000.00	0.35
3	110060	天路转债	400	45,036.00	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 市场中性策略执行情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，邮储银行于 2019 年 7 月 3 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定，罚款合计 140 万元。主要违法违规事实：（一）未按监管要求对代理营业机构进行考核；（二）劳务派遣工违规担任综合柜员；（三）员工信息管理不到位；（四）未按规定开展审计工作。

邮储银行于 2020 年 3 月 9 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定，罚款 50 万元。主要违法违规事实：（一）可回溯制度执行不到位；（二）可回溯基础管理不到位；（三）未传递或缺失可回溯视频资料；（四）质检不合格业务占比较高。

青岛银行于 2019 年 11 月 15 日收到中国人民银行济南分行行政处罚决定，被警告并处罚款 1500000 元，对 2 名相关责任人分别给予警告并处罚款 50000 元。主要违法违规事实：（一）违反人民币银行结算账户业务管理规定。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	140,538.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,850.46
5	应收申购款	25,823.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,212.29

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	645,729.00	0.45
2	110060	天路转债	45,036.00	0.03

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,972	43,379.96	0.00	0.00%	172,305,204.74	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	37,667.56	0.0219%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2018 年 2 月 1 日 ）基金份额总额	425,485,490.92
本报告期期初基金份额总额	243,481,336.86
本报告期基金总申购份额	3,723,226.09
减：本报告期基金总赎回份额	74,899,358.21
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	172,305,204.74

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人发生重大人事变动。根据国金基金管理有限公司第三届董事会审议通过，索峰先生自 2020 年 2 月 28 日起不再担任公司副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	910,771,280.41	48.32%	666,048.09	47.93%	-
天风证券	2	570,935,403.68	30.29%	417,523.98	30.05%	-
东方证券	1	198,540,101.76	10.53%	145,193.63	10.45%	-
联储证券	1	97,684,216.95	5.18%	71,436.05	5.14%	-
中信证券	1	55,537,502.52	2.95%	51,721.86	3.72%	-
国元证券	1	51,459,824.35	2.73%	37,632.69	2.71%	-

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. 本报告期新增联储证券、天风证券各一个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	512,322.10	100.00%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 1 月 17 日
2	《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	2020 年 2 月 29 日

		站	
3	《国金基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 3 月 26 日
4	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 17 日
5	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
6	《关于国金量化多策略灵活配置混合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	2020 年 6 月 11 日
7	《国金量化多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 12 日
8	《关于国金量化多策略灵活配置混合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	2020 年 6 月 20 日
9	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 日

注：本报告期内，基金管理人按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2020 年 8 月 27 日