

国金量化精选混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 3 月 18 日至 2022 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17

6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§9 开放式基金份额变动	59
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63

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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化精选混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化精选	
场内简称	-	
基金主代码	014805	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年3月18日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	75,786,683.38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	-	
下属分级基金的基金简称:	国金量化精选 A	国金量化精选 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	014805	014806
报告期末下属分级基金的份额总额	44,265,362.23份	31,521,321.15份

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过量化方法综合考虑标的中长期的表现，优选具有超额收益的个股构建投资组合，力求为基金份额持有人获取持续稳定的超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金“自上而下”构建选股模型，在风险模型约束下，紧密跟踪基准，严格控制运作风险，并根据各个子模型一定时期内的表现情况对其迭代，提高整体模型的适应能力，目标取得持续稳定的超额收益。	
业绩比较基准	中证500指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。	
	国金量化精选 A	国金量化精选 C
下属分级基金的风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽
	联系电话	010-88005632
		罗菲菲
		010-58560666

	电子邮箱	zhangli@gfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95568
传真		010-88005666	010-57093382
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 2 号
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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100089	100031
法定代表人		邵海波	高迎欣

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 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

基金级别	国金量化精选 A	国金量化精选 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年3月18日 - 2022年6月30日)	报告期(2022年3月18日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	8,838,649.09	8,251,933.06
本期利润	9,287,011.12	10,041,501.81
加权平均基金份额本期利润	0.1151	0.0872
本期加权平均净值利润率	11.34%	8.64%
本期基金份额净值增长率	14.18%	14.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	6,276,937.78	4,416,452.77
期末可供分配基金份额利润	0.1418	0.1401
期末基金资产净值	50,542,300.01	35,937,773.92
期末基金份额净值	1.1418	1.1401
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.18%	14.01%

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

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

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

4. 本基金合同自 2022 年 3 月 18 日生效，无上年度可比期间数据。

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

国金量化精选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.94%	1.21%	5.66%	0.88%	5.28%	0.33%
过去三个月	14.25%	0.92%	2.00%	1.40%	12.25%	-0.48%
自基金合同	14.18%	0.86%	2.80%	1.32%	11.38%	-0.46%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

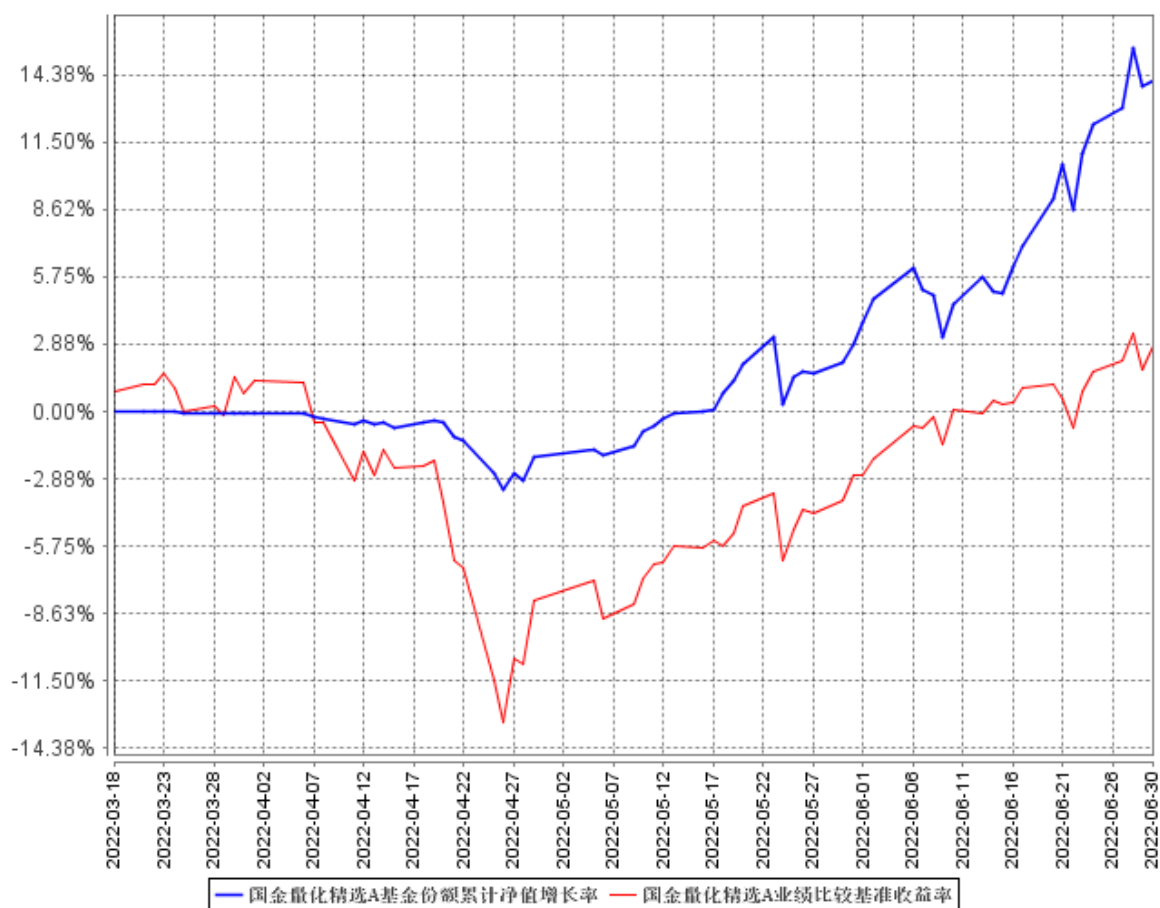
国金量化精选 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.89%	1.21%	5.66%	0.88%	5.23%	0.33%
过去三个月	14.10%	0.92%	2.00%	1.40%	12.10%	-0.48%
自基金合同生效起至今	14.01%	0.86%	2.80%	1.32%	11.21%	-0.46%

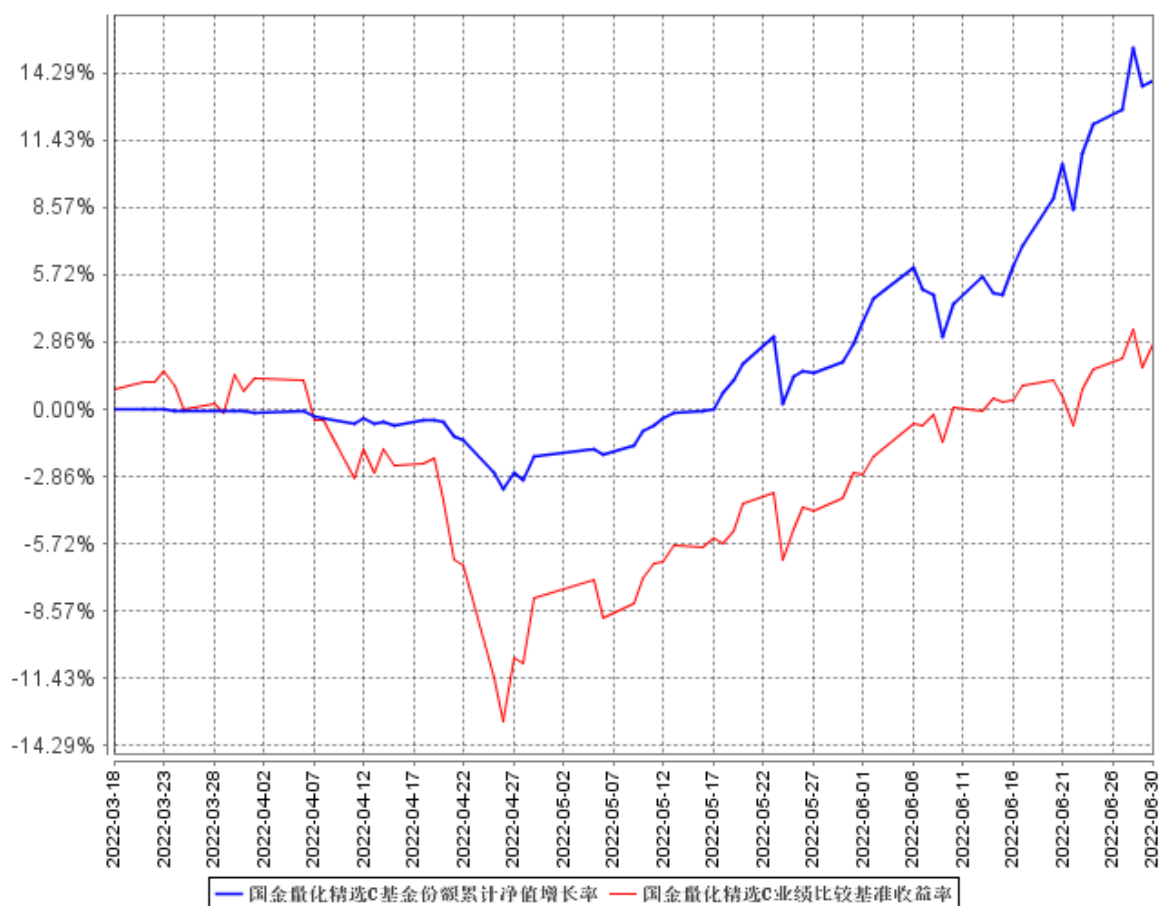
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国金量化精选A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



国金量化精选C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



注：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2022 年 3 月 18 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2022 年 3 月 18 日至 2022 年 9 月 17 日，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为49%、19.5%、19.5%、7%、1.5%、1.9%和1.6%。截至2022年6月30日，国金基金管理有限公司共管理28只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、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、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金、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、国金量化精选混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金惠利纯债债券型证券投资基金、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。

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	本基金基金经理，国金量化多因子、国金量化多策略	2022年3月18日	-	6	马芳女士，中国人民大学硕士，2003年7月至2016年5月历任华泰贝通网络科技有限公司担任IT事业部测试工程师，奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交

	基金经 理, 量化 投资事 业部副 总经理			易系统自动化测试部经 理, 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, 量化投资事业 部副总经理。
--	-----------------------------------	--	--	---

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

注：截至本报告期末，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》、《国金量化精选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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金以基本面结合市场情绪变量为基础，利用机器学习方法构建模型，通过预测市场风格因子等标的获取超额收益。2022年上半年市场波动有较为明显的提升，市场风格和行业变化较快，机会较为分散。一定程度上利于量化策略获取超额收益。产品建仓结束后基本保持较高仓位运作。

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1.1418元，累计单位净值为1.1418元；本报告期A类份额净值增长率为14.18%，同期业绩比较基准增长率为2.80%。

截至本报告期末，本基金C类份额单位净值为1.1401元，累计单位净值为1.1401元；本报告期C类份额净值增长率为14.01%，同期业绩比较基准增长率为2.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

量化策略对市场风格的极端表现较为敏感，市场风格相对均衡，机会分散的市场环境利于量化策略运作。

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，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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

报告截止日：2022年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,592,373.47	-
结算备付金		0.69	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	70,017,219.53	-
其中：股票投资		70,017,219.53	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		791,937.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		93,401,530.76	-
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		6,594,905.21	-
应付管理人报酬		194,596.77	-
应付托管费		32,432.81	-
应付销售服务费		34,728.49	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	64,793.55	-
负债合计		6,921,456.83	-
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	75,786,683.38	-
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,693,390.55	-
净资产合计		86,480,073.93	-
负债和净资产总计		93,401,530.76	-

注：1. 报告截止日 2022 年 6 月 30 日，国金量化精选 A 基金份额净值 1.1418 元，基金份额总额 44,265,362.23 份；国金量化精选 C 基金份额净值 1.1401 元，基金份额总额 31,521,321.15 份。国金量化精选份额总额合计为 75,786,683.38 份。

2. 本期财务报表的实际编制期间系 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 3 月 18 日(基 金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,546,210.11	-
1.利息收入		162,189.77	-
其中：存款利息收入	6.4.7.13	102,192.08	-
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		59,997.69	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,985,999.50	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	17,515,270.28	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	470,729.22	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,237,930.78	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	160,090.06	-
减：二、营业总支出		1,217,697.18	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	856,364.16	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	142,727.37	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	168,027.03	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	50,578.62	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,328,512.93	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,328,512.93	-
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,328,512.93	-

注：本基金合同于2022年3月18日生效，无上年度可比期间。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

本报告期：2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	218,397,464.38	-	-	218,397,464.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-142,610,781.00	-	10,693,390.55	-131,917,390.45
(一)、综合收益总额	-	-	19,328,512.93	19,328,512.93
(二)、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)	-142,610,781.00	-	-8,635,122.38	-151,245,903.38
其中：1.基金申购款	11,373,847.28	-	992,995.74	12,366,843.02
2.基金赎回款	-153,984,628.28	-	-9,628,118.12	-163,612,746.40
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	75,786,683.38	-	10,693,390.55	86,480,073.93
项目	上年度可比期间			

	2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	-	-	-	-
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(一)、综合收益总额	-	-	-	-
(二)、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)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-

注：本基金合同于2022年3月18日生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金量化精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），是经中国证监会 2021 年 12 月 24 日证监许可[2021]4097 号文注册募集。由国金基金管理有限公司于 2022 年 1 月 20 日至 2022 年 3 月 16 日向社会公开募集，基金合同于 2022 年 3 月 18 日生效。首次募集规模为 218,397,464.38 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财

务状况以及自 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公

允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	637,511.11
等于：本金	637,204.23
加：应计利息	306.88
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	21,954,862.36
等于：本金	21,953,039.07
加：应计利息	1,823.29
减：坏账准备	-
合计：	22,592,373.47

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	67,779,288.75	-	70,017,219.53	2,237,930.78
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	67,779,288.75	-	70,017,219.53	2,237,930.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,912.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
-	-

应付利息	-
预提费用	49,048.65
应付其他	3,832.50
合计	64,793.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化精选 A		
项目	本期 2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	86,397,165.61	86,397,165.61
本期申购	4,607,186.64	4,607,186.64
本期赎回(以“-”号填列)	-46,738,990.02	-46,738,990.02
- 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	44,265,362.23	44,265,362.23

金额单位：人民币元

国金量化精选 C		
项目	本期 2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	132,000,298.77	132,000,298.77
本期申购	6,766,660.64	6,766,660.64
本期赎回(以“-”号填列)	-107,245,638.26	-107,245,638.26
- 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	31,521,321.15	31,521,321.15

注：1. 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。

2. 本基金合同生效日为2022年3月18日。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金量化精选 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	8,838,649.09	448,362.03	9,287,011.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,347,991.08	-662,082.26	-3,010,073.34
其中：基金申购款	348,871.40	38,311.86	387,183.26
基金赎回款	-2,696,862.48	-700,394.12	-3,397,256.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,490,658.01	-213,720.23	6,276,937.78

单位：人民币元

国金量化精选 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	8,251,933.06	1,789,568.75	10,041,501.81
本期基金份额交易产生的变动数	-3,683,650.44	-1,941,398.60	-5,625,049.04
其中：基金申购款	532,178.47	73,634.01	605,812.48
基金赎回款	-4,215,828.91	-2,015,032.61	-6,230,861.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,568,282.62	-151,829.85	4,416,452.77

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日
活期存款利息收入	21,751.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	55,453.34
结算备付金利息收入	24,986.80
其他	-
合计	102,192.08

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日
卖出股票成交总额	308,601,796.51
减：卖出股票成本总额	290,376,299.87
减：交易费用	710,226.36
买卖股票差价收入	17,515,270.28

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	470,729.22
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	470,729.22

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年3月18日(基金合同生效日)至2022

	年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,237,930.78
——股票投资	2,237,930.78
——债券投资	-
——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	2,237,930.78

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年 6月30日
基金赎回费收入	160,090.06
合计	160,090.06

6.4.7.22 信用减值损失

注：无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月18日(基金合同生效日)至2022 年6月30日
审计费用	14,533.05
信息披露费	34,515.60
证券出借违约金	-
其他	400.00
银行费用	1,129.97
合计	50,578.62

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	856,364.16	-
其中：支付销售机构的客户维护费	29,940.31	-

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。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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、公休日等，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。

3. 本基金合同自2022年3月18日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	142,727.37	-

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2. 本基金合同自2022年3月18日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年3月18日(基金合同生效日)至2022年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化精选 A	国金量化精选 C	合计
	国金基金管理有限公司	-	77,196.53
国金证券股份有限公司	-	43.42	43.42
中国民生银行股份有限公司	-	3,408.59	3,408.59
合计	-	80,648.54	80,648.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化精选 A	国金量化精选 C	合计
	合计	-	-

注：1. 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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。

2. 本基金合同生效日为 2022 年 3 月 18 日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无

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

注：无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	637,511.11	21,751.94	-	-

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定的利率计息。

2. 本基金合同自 2022 年 3 月 18 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	22,592,373.47	-	-	-	-	-	-22,592,373.47
结算备付金	0.69	-	-	-	-	-	0.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-70,017,219.53	70,017,219.53
应收申购款	-	-	-	-	-	791,937.07	791,937.07
资产总计	22,592,374.16	-	-	-	-	-70,809,156.60	93,401,530.76
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-6,594,905.21	6,594,905.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	194,596.77	194,596.77
应付托管费	-	-	-	-	-	32,432.81	32,432.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,728.49	34,728.49
其他负债	-	-	-	-	-	64,793.55	64,793.55
负债总计	-	-	-	-	-	-6,921,456.83	6,921,456.83
利率敏感度缺口	22,592,374.16	-	-	-	-	-63,887,699.77	86,480,073.93
上年度末 2021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							

资产总计	-	-	-	-	-	-	-
负债							
负债总计	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本基金合同自 2022 年 3 月 18 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	70,017,219.53	80.96	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产—权证投资		-	-	-
其他		-	-	-
合计	70,017,219.53	80.96		-

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
相关风险变量的变动		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
+5%		1,428,610.13	-
-5%		-1,428,610.13	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	70,017,219.53	-
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	70,017,219.53	-

注：本基金合同自2022年3月18日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	70,017,219.53	74.96
	其中：股票	70,017,219.53	74.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,592,374.16	24.19
8	其他各项资产	791,937.07	0.85
9	合计	93,401,530.76	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	282,740.00	0.33
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,496,408.53	63.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	43,848.00	0.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,677,070.00	13.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	441,071.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	831,369.00	0.96

N	水利、环境和公共设施管理业	1,886,246.00	2.18
O	居民服务、修理和其他服务业	66,196.00	0.08
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	32,508.00	0.04
S	综合	259,763.00	0.30
	合计	70,017,219.53	80.96

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300123	亚光科技	236,700	1,467,540.00	1.70
2	300098	高新兴	388,200	1,416,930.00	1.64
3	300429	强力新材	143,700	1,363,713.00	1.58
4	300252	金信诺	167,400	1,292,328.00	1.49
5	300134	大富科技	153,700	1,252,655.00	1.45
6	300180	华峰超纤	306,100	1,227,461.00	1.42
7	300045	华力创通	153,300	1,175,811.00	1.36
8	300537	广信材料	90,600	1,114,380.00	1.29
9	300430	诚益通	107,100	1,096,704.00	1.27
10	002161	远望谷	197,400	988,974.00	1.14
11	300830	金现代	123,500	952,185.00	1.10
12	300211	亿通科技	101,800	876,498.00	1.01
13	300995	奇德新材	40,200	860,280.00	0.99
14	002796	世嘉科技	110,100	854,376.00	0.99
15	300397	天和防务	81,400	847,374.00	0.98
16	002151	北斗星通	26,700	842,652.00	0.97
17	300540	蜀道装备	38,100	840,867.00	0.97
18	300424	航新科技	74,400	839,232.00	0.97
19	300462	华铭智能	86,900	836,847.00	0.97
20	300168	万达信息	88,300	833,552.00	0.96
21	600645	中源协和	42,700	831,369.00	0.96
22	300735	光弘科技	79,400	829,730.00	0.96
23	300234	开尔新材	129,200	823,004.00	0.95

24	300017	网宿科技	151,500	812,040.00	0.94
25	300899	上海凯鑫	36,300	805,860.00	0.93
26	603106	恒银科技	156,400	805,460.00	0.93
27	301056	森赫股份	92,400	800,184.00	0.93
28	300931	通用电梯	103,500	800,055.00	0.93
29	300521	爱司凯	70,300	789,469.00	0.91
30	002308	威创股份	204,900	788,865.00	0.91
31	300402	宝色股份	39,100	787,865.00	0.91
32	301128	强瑞技术	25,900	783,475.00	0.91
33	300719	安达维尔	76,000	777,480.00	0.90
34	300116	保力新	374,200	755,884.00	0.87
35	300414	中光防雷	88,000	735,680.00	0.85
36	300950	德固特	41,500	676,450.00	0.78
37	300445	康斯特	58,300	668,118.00	0.77
38	300069	金利华电	33,000	637,230.00	0.74
39	300512	中亚股份	76,850	630,170.00	0.73
40	300562	乐心医疗	63,700	615,979.00	0.71
41	300300	海峡创新	147,000	612,990.00	0.71
42	300213	佳讯飞鸿	105,300	591,786.00	0.68
43	300816	艾可蓝	19,300	586,334.00	0.68
44	300877	金春股份	35,200	582,912.00	0.67
45	300302	同有科技	70,600	571,860.00	0.66
46	603679	华体科技	50,500	553,480.00	0.64
47	300637	扬帆新材	73,100	550,443.00	0.64
48	603686	福龙马	55,300	548,576.00	0.63
49	300230	永利股份	140,200	536,966.00	0.62
50	003036	泰坦股份	49,700	532,287.00	0.62
51	300067	安诺其	145,900	515,027.00	0.60
52	002622	融钰集团	160,000	512,000.00	0.59
53	300838	浙江力诺	33,000	504,570.00	0.58
54	300440	运达科技	76,000	503,880.00	0.58
55	002172	澳洋健康	135,100	495,817.00	0.57
56	000997	新大陆	36,200	478,202.00	0.55
57	600498	烽火通信	32,800	474,944.00	0.55
58	300439	美康生物	39,000	473,460.00	0.55
59	300616	尚品宅配	16,500	469,425.00	0.54
60	300493	润欣科技	67,600	468,468.00	0.54
61	001216	华瓷股份	36,000	462,600.00	0.53
62	000555	神州信息	40,900	461,352.00	0.53

63	300867	圣元环保	21,900	458,148.00	0.53
64	300333	兆日科技	67,500	453,600.00	0.52
65	603337	杰克股份	21,100	453,228.00	0.52
66	002835	同为股份	45,800	452,962.00	0.52
67	301082	久盛电气	23,900	443,345.00	0.51
68	300030	阳普医疗	60,300	438,984.00	0.51
69	300467	迅游科技	37,400	437,206.00	0.51
70	300959	线上线下	13,000	414,050.00	0.48
71	300925	法本信息	34,300	409,885.00	0.47
72	301053	远信工业	17,400	406,464.00	0.47
73	300453	三鑫医疗	40,600	403,564.00	0.47
74	300514	友讯达	38,300	399,469.00	0.46
75	300126	锐奇股份	64,000	387,840.00	0.45
76	600410	华胜天成	66,400	387,776.00	0.45
77	603598	引力传媒	42,400	387,536.00	0.45
78	605259	绿田机械	13,500	385,560.00	0.45
79	603976	正川股份	15,600	383,916.00	0.44
80	301009	可靠股份	29,100	363,168.00	0.42
81	300615	欣天科技	32,400	357,048.00	0.41
82	300314	戴维医疗	32,700	347,274.00	0.40
83	301016	雷尔伟	18,600	346,890.00	0.40
84	300096	易联众	49,800	333,660.00	0.39
85	300150	世纪瑞尔	80,200	323,206.00	0.37
86	300968	格林精密	34,700	314,382.00	0.36
87	300913	兆龙互连	19,800	314,226.00	0.36
88	300265	通光线缆	34,100	300,080.00	0.35
89	300717	华信新材	21,900	295,650.00	0.34
90	300634	彩讯股份	22,600	287,020.00	0.33
91	300511	雪榕生物	42,200	282,740.00	0.33
92	002634	棒杰股份	58,300	279,840.00	0.32
93	603042	华脉科技	27,100	278,588.00	0.32
94	000691	亚太实业	63,800	276,892.00	0.32
95	300889	爱克股份	19,200	274,176.00	0.32
96	300501	海顺新材	18,200	272,272.00	0.31
97	300419	浩丰科技	49,600	269,824.00	0.31
98	300935	盈建科	8,600	269,008.00	0.31
99	002983	芯瑞达	12,700	260,731.00	0.30
100	000551	创元科技	30,100	259,763.00	0.30
101	301002	崧盛股份	10,320	256,658.40	0.30

102	002658	雪迪龙	34,300	241,129.00	0.28
103	300922	天秦装备	13,300	238,868.00	0.28
104	301042	安联锐视	6,900	230,598.00	0.27
105	002730	电光科技	26,400	224,400.00	0.26
106	002165	红宝丽	45,500	212,940.00	0.25
107	300960	通业科技	11,200	209,664.00	0.24
108	300868	杰美特	11,600	207,408.00	0.24
109	300557	理工光科	7,600	206,720.00	0.24
110	300906	日月明	8,200	204,590.00	0.24
111	300749	顶固集创	27,500	202,675.00	0.23
112	300365	恒华科技	28,100	196,700.00	0.23
113	300281	金明精机	34,800	194,880.00	0.23
114	300145	中金环境	69,600	191,400.00	0.22
115	300865	大宏立	8,900	191,350.00	0.22
116	300711	广哈通信	15,900	184,440.00	0.21
117	300689	澄天伟业	10,500	181,755.00	0.21
118	300107	建新股份	34,100	181,071.00	0.21
119	300884	狄耐克	16,600	171,644.00	0.20
120	300845	捷安高科	12,500	170,000.00	0.20
121	300417	南华仪器	17,100	168,435.00	0.19
122	300923	研奥股份	7,300	168,265.00	0.19
123	002199	东晶电子	24,800	167,152.00	0.19
124	301028	东亚机械	15,100	163,382.00	0.19
125	300669	沪宁股份	16,900	159,536.00	0.18
126	300155	安居宝	28,300	157,065.00	0.18
127	605122	四方新材	8,600	154,800.00	0.18
128	300385	雪浪环境	23,600	154,580.00	0.18
129	002890	弘宇股份	8,800	147,224.00	0.17
130	300137	先河环保	24,300	138,267.00	0.16
131	603385	惠达卫浴	17,900	135,503.00	0.16
132	300743	天地数码	11,700	135,135.00	0.16
133	300789	唐源电气	6,100	123,037.00	0.14
134	301093	华兰股份	3,400	115,226.00	0.13
135	301178	天亿马	3,300	108,999.00	0.13
136	001211	双枪科技	4,400	108,240.00	0.13
137	300288	朗玛信息	10,400	107,640.00	0.12
138	300289	利德曼	16,900	106,301.00	0.12
139	300076	GQY 视讯	22,500	105,525.00	0.12
140	300380	安硕信息	7,200	104,688.00	0.12

141	002084	海鸥住工	23,300	91,802.00	0.11
142	600768	宁波富邦	9,800	89,964.00	0.10
143	000955	欣龙控股	20,100	89,847.00	0.10
144	002816	和科达	5,100	88,842.00	0.10
145	603516	淳中科技	6,500	80,470.00	0.09
146	002301	齐心集团	11,500	75,900.00	0.09
147	603718	海利生物	6,300	72,324.00	0.08
148	300823	建科机械	3,600	70,164.00	0.08
149	300389	艾比森	6,600	68,574.00	0.08
150	300449	汉邦高科	13,200	66,528.00	0.08
151	300736	百邦科技	6,700	66,196.00	0.08
152	002231	奥维通信	9,600	64,032.00	0.07
153	300277	海联讯	9,100	63,609.00	0.07
154	001209	洪兴股份	4,060	61,793.20	0.07
155	300779	惠城环保	4,600	61,778.00	0.07
156	002980	华盛昌	2,200	57,684.00	0.07
157	300862	蓝盾光电	2,100	56,868.00	0.07
158	002115	三维通信	12,900	53,535.00	0.06
159	300659	中孚信息	2,500	53,175.00	0.06
160	002494	华斯股份	12,500	52,750.00	0.06
161	603880	南卫股份	9,000	52,740.00	0.06
162	300908	仲景食品	1,400	52,682.00	0.06
163	300448	浩云科技	9,800	52,528.00	0.06
164	603226	菲林格尔	10,200	51,306.00	0.06
165	603768	常青股份	3,000	47,880.00	0.06
166	002963	豪尔赛	3,600	43,848.00	0.05
167	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.04
168	603389	亚振家居	6,600	36,300.00	0.04
169	300103	达刚控股	4,400	35,904.00	0.04
170	300625	三雄极光	2,900	34,858.00	0.04
171	603499	翔港科技	4,300	33,712.00	0.04
172	600715	文投控股	12,900	32,508.00	0.04
173	301067	显盈科技	800	31,568.00	0.04
174	605507	国邦医药	1,300	31,395.00	0.04
175	300880	迦南智能	2,000	29,460.00	0.03
176	300875	捷强装备	700	25,767.00	0.03
177	603321	梅轮电梯	3,800	24,738.00	0.03
178	603615	茶花股份	3,000	22,980.00	0.03
179	300594	朗进科技	1,100	18,700.00	0.02

180	300658	延江股份	1,800	16,488.00	0.02
181	300246	宝莱特	1,000	15,750.00	0.02
182	300563	神宇股份	1,200	14,544.00	0.02
183	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
184	603268	松发股份	500	9,660.00	0.01
185	603326	我乐家居	600	4,704.00	0.01
186	300321	同大股份	200	3,244.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	2,413,114.00	2.79
2	300891	惠云钛业	1,844,798.00	2.13
3	300582	英飞特	1,789,891.50	2.07
4	300457	赢合科技	1,667,177.00	1.93
5	300072	海新能科	1,630,038.00	1.88
6	300132	青松股份	1,589,398.00	1.84
7	300818	耐普矿机	1,586,841.00	1.83
8	300252	金信诺	1,581,990.00	1.83
9	300471	厚普股份	1,569,002.00	1.81
10	002527	新时达	1,568,698.00	1.81
11	600955	维远股份	1,560,971.00	1.81
12	300383	光环新网	1,554,213.00	1.80
13	002436	兴森科技	1,554,007.00	1.80
14	002947	恒铭达	1,550,332.00	1.79
15	300429	强力新材	1,547,931.00	1.79
16	300623	捷捷微电	1,545,382.00	1.79
17	300456	赛微电子	1,536,342.00	1.78
18	603650	彤程新材	1,513,029.00	1.75
19	300134	大富科技	1,501,262.00	1.74
20	300055	万邦达	1,500,141.00	1.73

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002456	欧菲光	2,499,319.00	2.89
2	300731	科创新源	2,249,387.00	2.60
3	300891	惠云钛业	2,044,074.00	2.36
4	300457	赢合科技	1,972,567.00	2.28
5	300097	智云股份	1,955,499.00	2.26
6	300582	英飞特	1,865,527.00	2.16
7	300657	弘信电子	1,843,807.00	2.13
8	300818	耐普矿机	1,773,692.00	2.05
9	002436	兴森科技	1,760,217.00	2.04
10	300456	赛微电子	1,756,063.22	2.03
11	300490	华自科技	1,728,765.00	2.00
12	300072	海新能科	1,718,347.00	1.99
13	002947	恒铭达	1,717,385.00	1.99
14	300222	科大智能	1,691,928.00	1.96
15	300383	光环新网	1,688,007.00	1.95
16	300441	鲍斯股份	1,680,745.00	1.94
17	603960	克来机电	1,668,136.00	1.93
18	603650	彤程新材	1,666,486.00	1.93
19	300143	盈康生命	1,639,387.00	1.90
20	300471	厚普股份	1,637,795.00	1.89

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	358,155,588.62
卖出股票收入（成交）总额	308,601,796.51

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未投资股指期货。

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

本基金报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，亚光科技股份有限公司于2022年2月10日受到国家税务总局沅江市税务局给予责令改正的行政处罚。

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。

7.12.2 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

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	791,937.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	791,937.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国金量化精选 A	1,414	31,305.07	-	-	44,265,362.23	100.00%
国金量化精选 C	726	43,417.80	530,204.50	1.68%	30,991,116.65	98.32%
合计	2,140	35,414.34	530,204.50	0.70%	75,256,478.88	99.30%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金量化精选 A	1,014,075.82	2.2909%
	国金量化精选 C	225,664.83	0.7159%
	合计	1,239,740.65	1.6358%

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	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	国金量化精选 A	0
	国金量化精选 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国金量化精选 A	>=100
	国金量化精选 C	0
	合计	>=100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化精选 A	国金量化精选 C
基金合同生效日（2022 年 3 月 18 日）基金份额总额	86,397,165.61	132,000,298.77
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,607,186.64	6,766,660.64
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	46,738,990.02	107,245,638.26
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	44,265,362.23	31,521,321.15

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

本基金管理人董事会于 2021 年 12 月 13 日审议通过了《关于批准国金基金管理有限公司原任董事、总经理尹庆军先生辞职的议案》、《关于董事长纪路先生提名邵海波先生担任国金基金管理有限公司总经理的议案》等议案，邵海波先生自 2022 年 1 月 28 日起担任公司总经理职务。

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

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东海证券	2	666,678,517.05	100.00%	348,434.80	100.00%	-

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

(1) 基金交易单元的选择标准如下：

- ① 券商经纪人经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；

④具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；

⑤交易佣金收取标准合理。

(2) 基金使用券商交易单元的选择程序如下：

①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券经营机构；

②本基金管理人和被选中的证券经营机构签订经济服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东海证券	-	-	810,177,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金量化精选混合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	2022年1月11日
2	《国金量化精选混合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	2022年1月11日
3	《国金量化精选混合型证券投资基金招募说明书》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月11日
4	《国金量化精选混合型证券投资基金份额发售公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月11日
5	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选A份额）基金产品资料概要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月11日
6	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选C份额）基金产品资料概要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年1月11日
7	《国金基金管理有限公司关于开展直销柜台申购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	2022年1月29日
8	《国金基金管理有限公司高	指定披露媒体和本	2022年1月29日

	级管理人员变更公告》	基金基金管理人网 站	
9	《关于国金量化精选混合型证券投资基金开展直销柜台认购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	2022年2月22日
10	《国金量化精选混合型证券投资基金延长募集期的公告》	指定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2022年2月25日
11	《关于国金量化精选混合型证券投资基金提前结束募集公告》	指定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2022年3月16日
12	《国金量化精选混合型证券投资基金基金合同生效公告》	指定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2022年3月19日
13	《关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告》	指定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2022年4月23日
14	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2022年4月30日
15	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本 基金基金管理人网 站	2022年5月28日
16	《关于国金量化精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、基金转换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	2022年6月8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

注：无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金量化精选混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化精选混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化精选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

2022 年 8 月 30 日