

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资 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：中国光大银行股份有限公司

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、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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 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	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	13
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	14
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	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 净资产（基金净值）变动表	19
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	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
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	72
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	73
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	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12 投资组合报告附注	73
§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§9 开放式基金份额变动	76
§10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81

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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§12 备查文件目录	82
12.1 备查文件目录	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 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	50,510,241.08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	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。</p> <p>2、量化选股模型</p> <p>(1) 多因子选股策略</p> <p>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。</p> <p>(2) 统计套利策略</p> <p>本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析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。</p> <p>(3) 事件驱动套利策略</p>

	<p>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。</p> <p>(4) 投资组合优化</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(2) 可转债投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、股票期权合约投资策略。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>7、国债期货投资策略</p>
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>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。</p> <p>8、权证投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	60%×中证 500 指数收益率+40%×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	张丽	石立平
	联系电话	010-88005632	010-63639180
	电子邮箱	zhangli@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		邵海波	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(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	1,909,347.11
本期利润	2,104,881.09
加权平均基金份额本期利润	0.0445
本期加权平均净值利润率	4.12%
本期基金份额净值增长率	4.28%
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	8,985,762.40
期末可供分配基金份额利润	0.1779
期末基金资产净值	60,316,423.86
期末基金份额净值	1.1941
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	19.41%

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

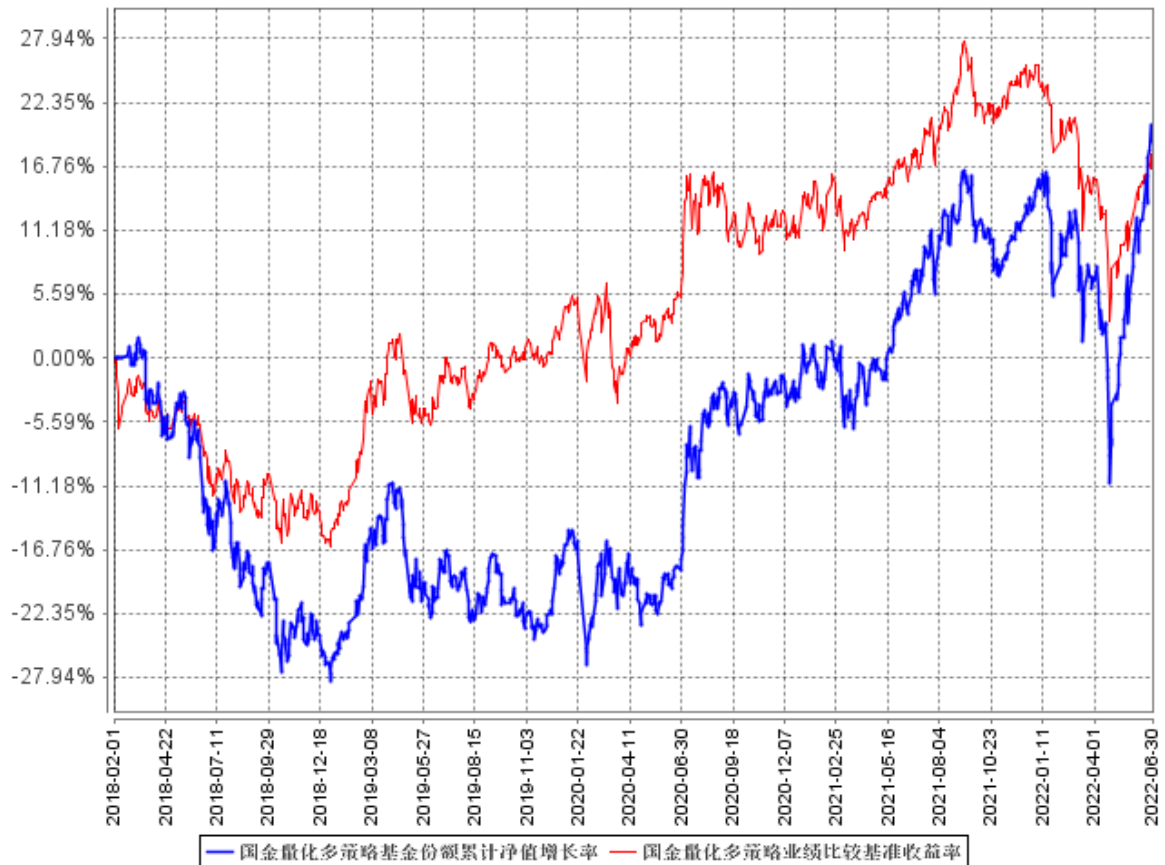
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.55%	1.13%	4.22%	0.66%	6.33%	0.47%
过去三个月	11.91%	1.76%	1.89%	1.05%	10.02%	0.71%
过去六个月	4.28%	1.58%	-6.52%	0.98%	10.80%	0.60%
过去一年	10.89%	1.22%	-0.65%	0.80%	11.54%	0.42%
过去三年	46.88%	1.11%	19.39%	0.76%	27.49%	0.35%
自基金合同生效起至今	19.41%	1.14%	17.41%	0.79%	2.00%	0.35%

注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“中证 500 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

国金量化多策略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：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 2022 年 6 月 30 日。

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、国金量化精选基	2020年9月3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

	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

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。报告期内产品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，本基金份额净值为 1.1941 元，累计单位净值为 1.1941 元，本报告期份额净值增长率为 4.28%，同期业绩比较基准增长率为-6.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，本基金存在连续二十个工作日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（以下简称“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遵规守信、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《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，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的真实、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 2022 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：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	3,011,040.13	84,094.14
结算备付金		1,425,936.37	11,141,502.37
存出保证金		130,128.93	51,413.67
交易性金融资产	6.4.7.2	53,043,488.95	27,522,544.40
其中：股票投资		50,730,247.00	24,517,644.40
基金投资		-	-
债券投资		2,313,241.95	3,004,900.00
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	5,007,000.00	5,634,000.00
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		1,016,689.11	253,012.19
应收股利		-	-
应收申购款		85,044.52	87,991.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	67,262.64
资产总计		63,719,328.01	44,841,820.70
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		385,929.94	301,329.29

应付赎回款		336,898.52	85,109.41
应付管理人报酬		66,442.17	64,994.23
应付托管费		11,073.69	10,832.36
应付销售服务费		-	-
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	2,602,559.83	1,650,586.84
负债合计		3,402,904.15	2,112,852.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	50,510,241.08	37,315,963.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,806,182.78	5,413,005.57
净资产合计		60,316,423.86	42,728,968.57
负债和净资产总计		63,719,328.01	44,841,820.70

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1941 元，基金份额总额 50,510,241.08 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 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		2,595,996.20	7,388,335.68
1.利息收入		83,137.58	133,673.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,280.15	46,677.63
债券利息收入		-	1,704.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,857.43	85,291.13
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,277,061.29	7,095,797.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,037,966.09	6,779,639.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	20,720.14	-10,684.30
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	218,375.06	326,842.45
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	195,533.98	154,589.00
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	40,263.35	4,275.50
减：二、营业总支出		491,115.11	1,592,294.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	378,449.78	522,888.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	63,074.95	87,148.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	49,590.38	982,257.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,104,881.09	5,796,041.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,104,881.09	5,796,041.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,104,881.09	5,796,041.42

6.3 净资产（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：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1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）	37,315,963.00	-	5,413,005.57	42,728,968.57
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）	37,315,963.00	-	5,413,005.57	42,728,968.57

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	13,194,278.08	-	4,393,177.21	17,587,455.29
(一)、综合收益总额	-	-	2,104,881.09	2,104,881.09
(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)	13,194,278.08	-	2,288,296.12	15,482,574.20
其中: 1.基金申购款	26,869,632.31	-	4,072,304.40	30,941,936.71
2.基金赎回款	-13,675,354.23	-	-1,784,008.28	-15,459,362.51
(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)	50,510,241.08	-	9,806,182.78	60,316,423.86
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)	110,221,627.53	-	-1,477,195.13	108,744,432.40
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)	110,221,627.53	-	-1,477,195.13	108,744,432.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-62,794,591.07	-	5,120,353.99	-57,674,237.08
(一)、综合收益总额	-	-	5,796,041.42	5,796,041.42
(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)	-62,794,591.07	-	-675,687.43	-63,470,278.50
其中: 1.基金申购款	825,748.46	-	3,488.34	829,236.80
2.基金赎回款	-63,620,339.53	-	-679,175.77	-64,299,515.30
(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）	47,427,036.46	-	3,643,158.86	51,070,195.32

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：

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

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%×中证 500 指数收益率+40%×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（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2022年1月1日至2022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 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 会计年度

-

6.4.4.2 记账本位币

-

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

-

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

6.4.4.7 实收基金

-

6.4.4.8 损益平准金

-

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

-

6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

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

-

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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统

称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 84,094.14 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 338.27 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 84,432.41 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,141,502.37 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,617.39 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,148,119.76 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 51,413.67 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 25.41 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 51,439.08 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,634,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币-1,487.75 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,632,512.25 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 87,991.29 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 87,991.29 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,262.64 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 338.27 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 6,617.39 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 25.41 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 61,769.32 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币-1,487.75 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,004,900.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 61,769.32 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,066,669.32 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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	3,011,040.13

等于：本金	3,010,326.81
加：应计利息	713.32
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	3,011,040.13

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	49,923,489.36	-	50,730,247.00	806,757.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	42,787.95	2,313,241.95	-454.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	42,787.95	2,313,241.95	-454.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,194,397.36	42,787.95	53,043,488.95	806,303.64

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,007,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,007,000.00	-

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	283.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,552,685.64
其中：交易所市场	2,552,685.64
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	49,590.38
合计	2,602,559.83

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	37,315,963.00	37,315,963.00
本期申购	26,869,632.31	26,869,632.31
本期赎回（以“-”号填列）	-13,675,354.23	-13,675,354.23
- 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	50,510,241.08	50,510,241.08

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

6.4.7.11 其他综合收益

注：无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,087,337.20	325,668.37	5,413,005.57
本期利润	1,909,347.11	195,533.98	2,104,881.09
本期基金份额交易产生的变动数	1,989,078.09	299,218.03	2,288,296.12
其中：基金申购款	3,689,691.29	382,613.11	4,072,304.40
基金赎回款	-1,700,613.20	-83,395.08	-1,784,008.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,985,762.40	820,420.38	9,806,182.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	8,927.45
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	13,640.78
其他	711.92
合计	23,280.15

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1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	751,593,850.92
减：卖出股票成本总额	747,484,113.97
减：交易费用	2,071,770.86
买卖股票差价收入	2,037,966.09

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	32,366.85
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-11,646.71
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	20,720.14

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,086,300.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,011,644.40
减：应计利息总额	86,300.00
减：交易费用	2.31
买卖债券差价收入	-11,646.71

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1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	218,375.06
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	218,375.06

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1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	195,533.98
——股票投资	189,243.58
——债券投资	6,290.40
——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	195,533.98

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	40,261.80
转出费收入	1.55
合计	40,263.35

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。

6.4.7.22 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1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
合计	49,590.38

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。

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例

国金证券股份有限公司	449,019,845.32	29.44%	257,473,922.93	40.37%
------------	----------------	--------	----------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1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	
	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
国金证券股份有	86,208,000.00	13.43%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国金证券股份有 限公司	328,370.14	27.58%	809,980.66	31.73%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国金证券股份有 限公司	188,290.58	38.26%	481,610.52	28.01%

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1月1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	378,449.78	522,888.93
其中：支付销售机构的客户维护费	114,126.69	245,885.27

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1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	63,074.95	87,148.17

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无

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1月1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
中国光大银行股份有限公司-活期存款	3,011,040.13	8,927.45	5,125,182.34	20,125.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，按银行同业利率计算。

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：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	3,011,040.13	-	-	-	-	-	3,011,040.13
结算备付金	1,425,936.37	-	-	-	-	-	1,425,936.37
存出保证金	130,128.93	-	-	-	-	-	130,128.93
交易性金融资产	2,313,241.95	-	-	-	-	50,730,247.00	53,043,488.95
买入返售金融资产	5,007,000.00	-	-	-	-	-	5,007,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,016,689.11	1,016,689.11
应收申购款	-	-	-	-	-	85,044.52	85,044.52
资产总计	11,887,347.38	-	-	-	-	51,831,980.63	63,719,328.01
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	385,929.94	385,929.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	336,898.52	336,898.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	66,442.17	66,442.17
应付托管费	-	-	-	-	-	11,073.69	11,073.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,552,685.64	2,552,685.64
其他负债	-	-	-	-	-	49,874.19	49,874.19
负债总计	-	-	-	-	-	3,402,904.15	3,402,904.15
利率敏感度缺口	11,887,347.38	-	-	-	-	48,429,076.48	60,316,423.86
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							
银行存款	84,094.14	-	-	-	-	-	84,094.14
结算备付金	11,141,502.37	-	-	-	-	-	11,141,502.37
存出保证金	51,413.67	-	-	-	-	-	51,413.67
交易性金融资产	-	-	3,004,900.00	-	-	24,517,644.40	27,522,544.40
买入返售金融资产	5,634,000.00	-	-	-	-	-	5,634,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	253,012.19	253,012.19
应收利息	-	-	-	-	-	67,262.64	67,262.64
应收申购款	-	-	-	-	-	87,991.29	87,991.29
资产总计	16,911,010.18	-	3,004,900.00	-	-	24,925,910.52	44,841,820.70

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	301,329.29	301,329.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	85,109.41	85,109.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,994.23	64,994.23
应付托管费	-	-	-	-	-	10,832.36	10,832.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,480,493.70	1,480,493.70
其他负债	-	-	-	-	-	170,093.14	170,093.14
负债总计	-	-	-	-	-	2,112,852.13	2,112,852.13
利率敏感度缺口	16,911,010.18	-3,004,900.00	-	-	-	-22,813,058.39	42,728,968.57

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-343.29	-2,189.76
	-25 个基点	343.74	2,193.22

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	50,730,247.00	84.11	24,517,644.40	57.38
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	50,730,247.00	84.11	24,517,644.40	57.38

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证500指数(000905.SH)变化5%，其他变量不变； Beta系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证500指数数据回归得出，反映了基金和中证500指数的相关性。		
	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)	
分析		本期末(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
	+5%	2,399,970.33	1,570,994.08
	-5%	-2,399,970.33	-1,570,994.08

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	-	-

注：本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	50,730,247.00	24,517,644.40
第二层次	2,313,241.95	3,004,900.00
第三层次	0.00	0.00
合计	53,043,488.95	27,522,544.40

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	50,730,247.00	79.62
	其中：股票	50,730,247.00	79.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,313,241.95	3.63
	其中：债券	2,313,241.95	3.63
	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	5,007,000.00	7.86
	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	4,436,976.50	6.96
8	其他各项资产	1,231,862.56	1.93
9	合计	63,719,328.01	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	222,110.00	0.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,223,262.00	61.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	378,210.00	0.63
E	建筑业	608,939.00	1.01
F	批发和零售业	629,323.00	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	87,527.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,623,632.00	14.30
J	金融业	31,349.00	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	517,738.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	810,884.00	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	1,056,158.00	1.75
O	居民服务、修理和其他服务业	95,836.00	0.16

P	教育	26,838.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	304,525.00	0.50
S	综合	113,916.00	0.19
	合计	50,730,247.00	84.11

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002916	深南电路	5,900	552,889.00	0.92
2	002821	凯莱英	1,900	549,100.00	0.91
3	300116	保力新	240,900	486,618.00	0.81
4	300017	网宿科技	85,600	458,816.00	0.76
5	600645	中源协和	21,900	426,393.00	0.71
6	002151	北斗星通	12,900	407,124.00	0.67
7	600201	生物股份	40,300	369,148.00	0.61
8	002465	海格通信	40,200	365,418.00	0.61
9	300465	高伟达	41,700	354,867.00	0.59
10	000997	新大陆	25,700	339,497.00	0.56
11	600516	方大炭素	41,300	313,880.00	0.52
12	000566	海南海药	68,100	311,217.00	0.52
13	600728	佳都科技	47,600	307,496.00	0.51
14	600435	北方导航	35,300	304,286.00	0.50
15	300397	天和防务	26,200	272,742.00	0.45
16	002389	航天彩虹	14,700	269,892.00	0.45
17	300634	彩讯股份	21,200	269,240.00	0.45
18	300006	莱美药业	64,600	268,090.00	0.44
19	002023	海特高新	25,500	260,865.00	0.43
20	300045	华力创通	33,100	253,877.00	0.42
21	300148	天舟文化	72,200	244,036.00	0.40
22	002375	亚厦股份	48,600	243,486.00	0.40
23	600118	中国卫星	12,000	240,960.00	0.40
24	300666	江丰电子	3,900	237,900.00	0.39
25	002212	天融信	23,400	237,510.00	0.39

26	603686	福龙马	23,800	236,096.00	0.39
27	300424	航新科技	20,700	233,496.00	0.39
28	600955	维远股份	8,000	230,720.00	0.38
29	300663	科蓝软件	14,900	230,652.00	0.38
30	300248	新开普	23,400	229,554.00	0.38
31	600715	文投控股	88,600	223,272.00	0.37
32	300061	旗天科技	27,300	216,489.00	0.36
33	300162	雷曼光电	29,900	212,589.00	0.35
34	002214	大立科技	16,600	211,152.00	0.35
35	300463	迈克生物	10,200	208,998.00	0.35
36	300659	中孚信息	9,800	208,446.00	0.35
37	300245	天玑科技	24,700	206,986.00	0.34
38	000801	四川九洲	29,300	199,533.00	0.33
39	603195	公牛集团	1,300	198,783.00	0.33
40	600879	航天电子	30,200	195,998.00	0.32
41	300877	金春股份	11,800	195,408.00	0.32
42	300830	金现代	24,800	191,208.00	0.32
43	002286	保龄宝	16,300	186,635.00	0.31
44	300430	诚益通	18,200	186,368.00	0.31
45	000158	常山北明	30,700	184,200.00	0.31
46	300453	三鑫医疗	18,400	182,896.00	0.30
47	300875	捷强装备	4,900	180,369.00	0.30
48	300011	鼎汉技术	29,100	176,346.00	0.29
49	300205	天喻信息	14,400	173,808.00	0.29
50	000568	泸州老窖	700	172,578.00	0.29
51	300211	亿通科技	20,000	172,200.00	0.29
52	300906	日月明	6,900	172,155.00	0.29
53	000823	超声电子	16,600	171,644.00	0.28
54	300163	先锋新材	49,900	169,660.00	0.28
55	300213	佳讯飞鸿	30,000	168,600.00	0.28
56	300872	天阳科技	12,600	167,958.00	0.28
57	300823	建科机械	8,600	167,614.00	0.28
58	301009	可靠股份	13,400	167,232.00	0.28
59	002835	同为股份	16,900	167,141.00	0.28
60	600410	华胜天成	28,600	167,024.00	0.28
61	605507	国邦医药	6,900	166,635.00	0.28
62	300987	川网传媒	9,800	165,326.00	0.27
63	300440	运达科技	24,800	164,424.00	0.27
64	600812	华北制药	24,300	163,296.00	0.27

65	300053	欧比特	19,600	163,268.00	0.27
66	300076	GQY 视讯	34,600	162,274.00	0.27
67	300150	世纪瑞尔	40,100	161,603.00	0.27
68	603516	淳中科技	13,000	160,940.00	0.27
69	000691	亚太实业	36,900	160,146.00	0.27
70	002796	世嘉科技	20,500	159,080.00	0.26
71	300326	凯利泰	18,800	155,288.00	0.26
72	300252	金信诺	20,100	155,172.00	0.26
73	300226	上海钢联	6,800	154,020.00	0.26
74	300314	戴维医疗	14,500	153,990.00	0.26
75	300300	海峡创新	36,900	153,873.00	0.26
76	300749	顶固集创	20,800	153,296.00	0.25
77	603698	航天工程	11,800	152,456.00	0.25
78	300067	安诺其	43,100	152,143.00	0.25
79	301082	久盛电气	8,200	152,110.00	0.25
80	300562	乐心医疗	15,700	151,819.00	0.25
81	300770	新媒股份	4,000	151,320.00	0.25
82	300445	康斯特	13,200	151,272.00	0.25
83	002890	弘宇股份	9,000	150,570.00	0.25
84	300968	格林精密	16,600	150,396.00	0.25
85	002658	雪迪龙	21,300	149,739.00	0.25
86	605122	四方新材	8,300	149,400.00	0.25
87	002065	东华软件	23,600	149,152.00	0.25
88	300378	鼎捷软件	9,000	148,230.00	0.25
89	300389	艾比森	14,200	147,538.00	0.24
90	002231	奥维通信	22,100	147,407.00	0.24
91	002138	顺络电子	5,400	147,150.00	0.24
92	300429	强力新材	15,500	147,095.00	0.24
93	300385	雪浪环境	22,400	146,720.00	0.24
94	300302	同有科技	18,100	146,610.00	0.24
95	300379	东方通	8,200	144,402.00	0.24
96	300333	兆日科技	21,400	143,808.00	0.24
97	300991	创益通	10,000	143,800.00	0.24
98	301002	崧盛股份	5,760	143,251.20	0.24
99	002573	清新环境	24,500	142,345.00	0.24
100	600768	宁波富邦	15,500	142,290.00	0.24
101	300042	朗科科技	11,200	141,904.00	0.24
102	002842	翔鹭钨业	16,500	140,910.00	0.23
103	603042	华脉科技	13,700	140,836.00	0.23

104	300342	天银机电	15,300	140,760.00	0.23
105	600855	航天长峰	12,500	140,375.00	0.23
106	300318	博晖创新	21,200	138,648.00	0.23
107	300725	药石科技	1,400	138,586.00	0.23
108	300155	安居宝	24,700	137,085.00	0.23
109	300176	派生科技	25,300	136,367.00	0.23
110	300259	新天科技	37,800	136,080.00	0.23
111	002156	通富微电	8,800	135,520.00	0.22
112	603025	大豪科技	6,200	135,408.00	0.22
113	000777	中核科技	12,300	135,300.00	0.22
114	300488	恒锋工具	5,400	134,838.00	0.22
115	300467	迅游科技	11,500	134,435.00	0.22
116	300868	杰美特	7,500	134,100.00	0.22
117	300131	英唐智控	25,400	133,096.00	0.22
118	603927	中科软	5,700	132,924.00	0.22
119	300521	爱司凯	11,800	132,514.00	0.22
120	600810	神马股份	14,600	131,400.00	0.22
121	600199	金种子酒	4,600	130,410.00	0.22
122	603598	引力传媒	14,100	128,874.00	0.21
123	601827	三峰环境	18,000	128,160.00	0.21
124	300880	迦南智能	8,700	128,151.00	0.21
125	603058	永吉股份	18,100	128,148.00	0.21
126	600299	安迪苏	13,300	127,414.00	0.21
127	300642	透景生命	5,600	127,008.00	0.21
128	300275	梅安森	9,500	126,065.00	0.21
129	000586	汇源通信	15,300	125,919.00	0.21
130	300230	永利股份	32,700	125,241.00	0.21
131	300753	爱朋医疗	8,800	124,696.00	0.21
132	300514	友讯达	11,900	124,117.00	0.21
133	002878	元隆雅图	6,400	123,520.00	0.20
134	300931	通用电梯	15,900	122,907.00	0.20
135	300414	中光防雷	14,700	122,892.00	0.20
136	002381	双箭股份	19,100	122,622.00	0.20
137	300096	易联众	18,300	122,610.00	0.20
138	300726	宏达电子	2,000	122,340.00	0.20
139	000021	深科技	10,400	121,056.00	0.20
140	600498	烽火通信	8,300	120,184.00	0.20
141	301065	本立科技	2,900	119,886.00	0.20
142	300632	光莆股份	10,900	119,137.00	0.20

143	002614	奥佳华	13,700	118,642.00	0.20
144	301093	华兰股份	3,500	118,615.00	0.20
145	002383	合众思壮	19,800	118,206.00	0.20
146	300735	光弘科技	11,300	118,085.00	0.20
147	300965	恒宇信通	2,500	117,925.00	0.20
148	300417	南华仪器	11,900	117,215.00	0.19
149	300922	天秦装备	6,500	116,740.00	0.19
150	600100	同方股份	26,200	116,590.00	0.19
151	300899	上海凯鑫	5,200	115,440.00	0.19
152	300481	濮阳惠成	4,900	115,150.00	0.19
153	600800	渤海化学	28,000	115,080.00	0.19
154	300670	大烨智能	15,100	115,062.00	0.19
155	002861	瀛通通讯	10,800	114,804.00	0.19
156	002084	海鸥住工	29,100	114,654.00	0.19
157	600889	南京化纤	24,000	114,480.00	0.19
158	002429	兆驰股份	29,700	114,048.00	0.19
159	000551	创元科技	13,200	113,916.00	0.19
160	603828	柯利达	33,500	113,900.00	0.19
161	301016	雷尔伟	6,100	113,765.00	0.19
162	301042	安联锐视	3,400	113,628.00	0.19
163	002338	奥普光电	6,400	113,600.00	0.19
164	603931	格林达	5,600	112,560.00	0.19
165	002282	博深股份	14,800	112,036.00	0.19
166	605259	绿田机械	3,900	111,384.00	0.18
167	300862	蓝盾光电	4,100	111,028.00	0.18
168	300838	浙江力诺	7,200	110,088.00	0.18
169	300520	科大国创	6,800	109,208.00	0.18
170	300281	金明精机	19,400	108,640.00	0.18
171	300177	中海达	13,400	108,406.00	0.18
172	300444	双杰电气	20,200	108,272.00	0.18
173	301028	东亚机械	10,000	108,200.00	0.18
174	000039	中集集团	7,800	108,030.00	0.18
175	600990	四创电子	2,600	107,510.00	0.18
176	600436	片仔癀	300	107,019.00	0.18
177	300637	扬帆新材	14,200	106,926.00	0.18
178	603601	再升科技	16,800	106,848.00	0.18
179	002745	木林森	10,900	106,493.00	0.18
180	603339	四方科技	9,300	106,392.00	0.18
181	300935	盈建科	3,400	106,352.00	0.18

182	301178	天亿马	3,200	105,696.00	0.18
183	603386	骏亚科技	6,700	105,123.00	0.17
184	300234	开尔新材	16,500	105,105.00	0.17
185	002130	沃尔核材	17,100	104,994.00	0.17
186	600722	金牛化工	19,300	104,992.00	0.17
187	603131	上海沪工	7,600	104,424.00	0.17
188	600667	太极实业	14,100	104,058.00	0.17
189	300103	达刚控股	12,600	102,816.00	0.17
190	002495	佳隆股份	37,500	102,750.00	0.17
191	300717	华信新材	7,500	101,250.00	0.17
192	603669	灵康药业	15,400	100,716.00	0.17
193	002162	悦心健康	21,900	99,426.00	0.16
194	300800	力合科技	6,000	99,240.00	0.16
195	002199	东晶电子	14,700	99,078.00	0.16
196	002825	纳尔股份	8,900	98,701.00	0.16
197	003036	泰坦股份	9,200	98,532.00	0.16
198	600737	中粮糖业	13,100	98,512.00	0.16
199	002165	红宝丽	21,000	98,280.00	0.16
200	300289	利德曼	15,600	98,124.00	0.16
201	601038	一拖股份	8,700	97,962.00	0.16
202	300405	科隆股份	16,770	97,936.80	0.16
203	300348	长亮科技	10,100	97,566.00	0.16
204	603489	八方股份	500	97,245.00	0.16
205	603711	香飘飘	8,000	97,040.00	0.16
206	300615	欣天科技	8,700	95,874.00	0.16
207	300736	百邦科技	9,700	95,836.00	0.16
208	300959	线上线下	3,000	95,550.00	0.16
209	603657	春光科技	6,300	93,870.00	0.16
210	300948	冠中生态	5,900	93,633.00	0.16
211	003015	日久光电	9,900	93,159.00	0.15
212	000062	深圳华强	7,300	92,710.00	0.15
213	300975	商络电子	10,500	92,085.00	0.15
214	300335	迪森股份	18,900	91,665.00	0.15
215	003018	金富科技	9,900	91,575.00	0.15
216	002855	捷荣技术	11,500	90,275.00	0.15
217	600590	泰豪科技	13,800	90,114.00	0.15
218	300876	蒙泰高新	4,000	89,560.00	0.15
219	300288	朗玛信息	8,600	89,010.00	0.15
220	003027	同兴环保	5,100	88,995.00	0.15

221	001211	双枪科技	3,600	88,560.00	0.15
222	300865	大宏立	4,000	86,000.00	0.14
223	601698	中国卫通	7,600	85,956.00	0.14
224	002649	博彦科技	8,400	85,764.00	0.14
225	300950	德固特	5,250	85,575.00	0.14
226	002653	海思科	5,300	85,383.00	0.14
227	002688	金河生物	17,900	85,025.00	0.14
228	300306	远方信息	7,500	84,675.00	0.14
229	300493	润欣科技	12,200	84,546.00	0.14
230	002392	北京利尔	22,500	84,150.00	0.14
231	603916	苏博特	3,300	84,117.00	0.14
232	603050	科林电气	6,000	82,140.00	0.14
233	002983	芯瑞达	4,000	82,120.00	0.14
234	000989	九芝堂	9,000	81,900.00	0.14
235	300557	理工光科	3,000	81,600.00	0.14
236	300925	法本信息	6,800	81,260.00	0.13
237	300232	洲明科技	12,400	80,848.00	0.13
238	300923	研奥股份	3,500	80,675.00	0.13
239	300985	致远新能	2,800	80,360.00	0.13
240	300349	金卡智能	8,200	79,868.00	0.13
241	300004	南风股份	12,400	79,484.00	0.13
242	301053	远信工业	3,400	79,424.00	0.13
243	301011	华立科技	2,400	78,936.00	0.13
244	301067	显盈科技	2,000	78,920.00	0.13
245	603890	春秋电子	8,000	78,880.00	0.13
246	001218	丽臣实业	3,300	78,804.00	0.13
247	301128	强瑞技术	2,600	78,650.00	0.13
248	300154	瑞凌股份	13,400	78,390.00	0.13
249	300895	铜牛信息	2,700	78,354.00	0.13
250	300952	恒辉安防	4,500	78,300.00	0.13
251	002308	威创股份	20,300	78,155.00	0.13
252	002752	昇兴股份	15,600	77,532.00	0.13
253	300480	光力科技	4,300	77,142.00	0.13
254	300187	永清环保	13,000	75,790.00	0.13
255	300711	广哈通信	6,500	75,400.00	0.13
256	300399	天利科技	7,000	75,390.00	0.12
257	300512	中亚股份	9,150	75,030.00	0.12
258	300640	德艺文创	12,700	74,930.00	0.12
259	300125	聆达股份	4,600	74,290.00	0.12

260	300697	电工合金	7,100	74,266.00	0.12
261	300168	万达信息	7,800	73,632.00	0.12
262	300869	康泰医学	2,600	73,476.00	0.12
263	301086	鸿富瀚	1,200	72,660.00	0.12
264	001210	金房节能	2,900	72,645.00	0.12
265	002169	智光电气	8,600	72,584.00	0.12
266	603718	海利生物	6,300	72,324.00	0.12
267	300253	卫宁健康	8,200	71,996.00	0.12
268	603385	惠达卫浴	9,500	71,915.00	0.12
269	300069	金利华电	3,700	71,447.00	0.12
270	603220	中贝通信	5,700	71,421.00	0.12
271	003003	天元股份	7,600	69,540.00	0.12
272	300864	南大环境	3,300	69,300.00	0.11
273	300918	南山智尚	8,100	69,255.00	0.11
274	300689	澄天伟业	4,000	69,240.00	0.11
275	002912	中新赛克	2,800	69,048.00	0.11
276	001202	炬申股份	4,700	69,043.00	0.11
277	000533	顺钠股份	19,000	68,970.00	0.11
278	300404	博济医药	8,100	68,445.00	0.11
279	300962	中金辐照	4,500	67,950.00	0.11
280	000955	欣龙控股	15,200	67,944.00	0.11
281	000593	德龙汇能	12,100	67,760.00	0.11
282	600131	国网信通	5,000	67,250.00	0.11
283	300315	掌趣科技	20,100	67,134.00	0.11
284	300883	龙利得	9,700	67,027.00	0.11
285	300270	中威电子	11,300	67,009.00	0.11
286	605162	新中港	7,400	66,970.00	0.11
287	300321	同大股份	4,100	66,502.00	0.11
288	601566	九牧王	7,800	65,988.00	0.11
289	300241	瑞丰光电	11,600	65,888.00	0.11
290	603615	茶花股份	8,600	65,876.00	0.11
291	300504	天邑股份	3,700	65,712.00	0.11
292	002980	华盛昌	2,500	65,550.00	0.11
293	300120	经纬辉开	9,400	65,142.00	0.11
294	300721	怡达股份	1,800	64,926.00	0.11
295	300867	圣元环保	3,100	64,852.00	0.11
296	300560	中富通	4,300	64,758.00	0.11
297	600088	中视传媒	7,100	64,610.00	0.11
298	603387	基蛋生物	4,500	64,170.00	0.11

299	605318	法狮龙	4,400	64,020.00	0.11
300	603320	迪贝电气	5,300	63,494.00	0.11
301	300762	上海瀚讯	5,700	63,441.00	0.11
302	300719	安达维尔	6,200	63,426.00	0.11
303	301075	多瑞医药	2,300	63,204.00	0.10
304	002880	卫光生物	2,400	63,168.00	0.10
305	300832	新产业	1,400	63,154.00	0.10
306	300447	全信股份	3,100	63,147.00	0.10
307	300884	狄耐克	6,100	63,074.00	0.10
308	000953	河化股份	10,400	62,920.00	0.10
309	600468	百利电气	13,700	62,883.00	0.10
310	002690	美亚光电	2,900	62,872.00	0.10
311	000901	航天科技	6,900	62,721.00	0.10
312	002816	和科达	3,600	62,712.00	0.10
313	600739	辽宁成大	4,300	62,694.00	0.10
314	002634	棒杰股份	13,000	62,400.00	0.10
315	300074	华平股份	16,500	62,040.00	0.10
316	300449	汉邦高科	12,300	61,992.00	0.10
317	605058	澳弘电子	3,200	61,760.00	0.10
318	300227	光韵达	8,400	61,656.00	0.10
319	300107	建新股份	11,500	61,065.00	0.10
320	300898	熊猫乳品	2,700	60,750.00	0.10
321	300963	中洲特材	3,100	60,078.00	0.10
322	300525	博思软件	2,800	60,060.00	0.10
323	002225	濮耐股份	14,900	59,749.00	0.10
324	603579	荣泰健康	2,400	59,160.00	0.10
325	603726	朗迪集团	4,900	58,800.00	0.10
326	603877	太平鸟	2,900	58,696.00	0.10
327	002730	电光科技	6,900	58,650.00	0.10
328	300669	沪宁股份	6,200	58,528.00	0.10
329	300092	科新机电	5,800	58,406.00	0.10
330	603336	宏辉果蔬	9,100	58,149.00	0.10
331	002911	佛燃能源	6,400	58,112.00	0.10
332	603268	松发股份	3,000	57,960.00	0.10
333	300119	瑞普生物	3,300	57,717.00	0.10
334	002315	焦点科技	4,100	57,482.00	0.10
335	300889	爱克股份	4,000	57,120.00	0.09
336	603976	正川股份	2,300	56,603.00	0.09
337	603313	梦百合	4,700	56,400.00	0.09

338	301043	绿岛风	2,200	56,386.00	0.09
339	301081	严牌股份	3,700	55,796.00	0.09
340	603328	依顿电子	8,500	53,975.00	0.09
341	600337	美克家居	17,600	53,856.00	0.09
342	300277	海联讯	7,600	53,124.00	0.09
343	300739	明阳电路	3,300	52,866.00	0.09
344	605398	新炬网络	1,500	52,635.00	0.09
345	300591	万里马	9,100	52,507.00	0.09
346	300589	江龙船艇	2,700	52,488.00	0.09
347	300686	智动力	4,500	52,335.00	0.09
348	300515	三德科技	5,100	52,020.00	0.09
348	603912	佳力图	4,500	52,020.00	0.09
349	002871	伟隆股份	5,200	52,000.00	0.09
350	605066	天正电气	5,800	51,910.00	0.09
351	300845	捷安高科	3,800	51,680.00	0.09
352	603610	麒盛科技	3,800	51,338.00	0.09
353	603933	睿能科技	4,700	51,324.00	0.09
354	603389	亚振家居	9,300	51,150.00	0.08
355	300779	惠城环保	3,800	51,034.00	0.08
356	603106	恒银科技	9,900	50,985.00	0.08
357	300036	超图软件	2,600	50,804.00	0.08
358	300135	宝利国际	19,600	50,568.00	0.08
359	000869	张裕 A	1,700	50,558.00	0.08
360	603113	金能科技	4,500	49,770.00	0.08
361	603214	爱婴室	2,700	48,735.00	0.08
362	603697	有友食品	3,700	48,729.00	0.08
363	600531	豫光金铅	9,200	48,484.00	0.08
364	300242	佳云科技	14,700	48,363.00	0.08
365	002303	美盈森	14,000	48,300.00	0.08
366	002726	龙大美食	4,500	47,970.00	0.08
367	300238	冠昊生物	3,300	47,949.00	0.08
368	603989	艾华集团	1,700	47,940.00	0.08
369	002570	贝因美	9,500	47,025.00	0.08
370	300971	博亚精工	1,900	46,835.00	0.08
371	002555	三七互娱	2,200	46,706.00	0.08
372	002063	远光软件	6,600	46,398.00	0.08
373	300371	汇中股份	3,800	46,132.00	0.08
374	300195	长荣股份	8,200	46,002.00	0.08
375	605088	冠盛股份	3,400	45,832.00	0.08

376	603508	思维列控	3,400	45,526.00	0.08
377	601616	广电电气	14,000	45,500.00	0.08
378	300972	万辰生物	3,500	45,255.00	0.08
379	300030	阳普医疗	6,200	45,136.00	0.07
380	301006	迈拓股份	2,400	45,120.00	0.07
381	300857	协创数据	2,200	45,078.00	0.07
382	300380	安硕信息	3,100	45,074.00	0.07
383	301024	霍普股份	1,700	44,574.00	0.07
384	600261	阳光照明	13,200	44,484.00	0.07
385	002546	新联电子	11,700	43,875.00	0.07
386	600343	航天动力	4,100	43,624.00	0.07
387	002190	成飞集成	1,600	43,520.00	0.07
388	300319	麦捷科技	4,700	43,334.00	0.07
389	301056	森赫股份	5,000	43,300.00	0.07
390	600543	莫高股份	7,000	43,260.00	0.07
391	300542	新晨科技	3,700	42,550.00	0.07
392	001216	华瓷股份	3,300	42,405.00	0.07
393	300455	康拓红外	4,900	41,993.00	0.07
394	600967	内蒙一机	4,600	41,952.00	0.07
395	000488	晨鸣纸业	7,400	41,736.00	0.07
396	300743	天地数码	3,600	41,580.00	0.07
396	600562	国睿科技	2,800	41,580.00	0.07
397	603488	展鹏科技	5,800	41,528.00	0.07
398	002679	福建金森	3,800	41,344.00	0.07
399	300921	南凌科技	2,100	41,265.00	0.07
400	601882	海天精工	2,000	41,220.00	0.07
401	600362	江西铜业	2,300	41,009.00	0.07
402	603226	菲林格尔	8,100	40,743.00	0.07
403	000976	华铁股份	9,500	40,565.00	0.07
404	601686	友发集团	5,300	40,492.00	0.07
405	002773	康弘药业	2,700	40,338.00	0.07
406	300531	优博讯	2,900	40,310.00	0.07
407	002346	柘中股份	3,100	40,300.00	0.07
408	603030	全筑股份	13,200	40,260.00	0.07
409	603187	海容冷链	1,100	40,205.00	0.07
410	002767	先锋电子	3,800	40,090.00	0.07
411	603685	晨丰科技	3,900	40,014.00	0.07
412	300608	思特奇	4,400	39,952.00	0.07
413	603829	洛凯股份	3,800	39,672.00	0.07

414	300847	中船汉光	3,100	39,525.00	0.07
415	300816	艾可蓝	1,300	39,494.00	0.07
416	300538	同益股份	3,000	38,850.00	0.06
417	300815	玉禾田	2,200	38,258.00	0.06
418	603000	人民网	3,400	38,080.00	0.06
419	300283	温州宏丰	6,200	37,634.00	0.06
420	300933	中辰股份	4,500	36,675.00	0.06
421	003023	彩虹集团	2,100	36,120.00	0.06
422	002989	中天精装	2,500	36,050.00	0.06
423	603238	诺邦股份	3,400	36,040.00	0.06
424	300206	理邦仪器	3,500	35,875.00	0.06
425	002969	嘉美包装	8,700	35,496.00	0.06
426	003004	声迅股份	1,700	35,462.00	0.06
427	002345	潮宏基	7,700	35,343.00	0.06
428	003020	立方制药	1,200	35,304.00	0.06
429	300137	先河环保	6,200	35,278.00	0.06
430	603020	爱普股份	3,300	34,914.00	0.06
431	600613	神奇制药	5,800	34,452.00	0.06
432	603196	日播时尚	5,300	34,238.00	0.06
433	605167	利柏特	4,300	34,099.00	0.06
434	300970	华绿生物	1,800	34,056.00	0.06
435	300908	仲景食品	900	33,867.00	0.06
436	002643	万润股份	1,600	33,376.00	0.06
437	300540	蜀道装备	1,500	33,105.00	0.05
438	300194	福安药业	8,800	33,000.00	0.05
439	600605	汇通能源	4,000	32,840.00	0.05
440	603699	纽威股份	3,900	32,799.00	0.05
441	301076	新瀚新材	1,200	32,760.00	0.05
442	603926	铁流股份	3,100	31,837.00	0.05
443	300419	浩丰科技	5,800	31,552.00	0.05
444	603977	国泰集团	3,600	31,212.00	0.05
445	300511	雪榕生物	4,600	30,820.00	0.05
446	600271	航天信息	2,800	30,632.00	0.05
447	000878	云南铜业	2,600	29,614.00	0.05
448	003033	征和工业	1,100	29,480.00	0.05
449	002148	北纬科技	6,000	29,460.00	0.05
450	002857	三晖电气	1,800	28,656.00	0.05
451	603083	剑桥科技	2,800	28,420.00	0.05
452	600169	太原重工	11,500	28,290.00	0.05

453	601956	东贝集团	4,400	28,116.00	0.05
454	603808	歌力思	2,900	28,072.00	0.05
455	601163	三角轮胎	2,400	27,984.00	0.05
456	002293	罗莱生活	2,100	27,657.00	0.05
457	301041	金百泽	1,400	27,594.00	0.05
458	603022	新通联	3,000	27,390.00	0.05
459	002042	华孚时尚	7,200	27,216.00	0.05
460	600983	惠而浦	3,500	27,125.00	0.04
461	002342	巨力索具	6,800	26,860.00	0.04
462	600455	博通股份	1,400	26,838.00	0.04
463	002494	华斯股份	6,300	26,586.00	0.04
464	300016	北陆药业	3,500	26,495.00	0.04
465	000008	神州高铁	10,500	26,250.00	0.04
466	002869	金溢科技	1,700	25,636.00	0.04
467	000590	启迪药业	3,100	25,482.00	0.04
468	000032	深桑达 A	1,700	25,466.00	0.04
469	300123	亚光科技	4,100	25,420.00	0.04
470	300831	派瑞股份	1,800	25,416.00	0.04
471	002616	长青集团	5,200	25,012.00	0.04
472	300583	赛托生物	1,100	24,860.00	0.04
473	603739	蔚蓝生物	1,600	24,800.00	0.04
474	300099	精准信息	3,500	24,605.00	0.04
475	002595	豪迈科技	1,100	24,574.00	0.04
476	300406	九强生物	1,400	24,206.00	0.04
477	600501	航天晨光	2,100	23,877.00	0.04
478	600097	开创国际	2,400	23,592.00	0.04
479	603880	南卫股份	4,000	23,440.00	0.04
480	603583	捷昌驱动	700	23,373.00	0.04
481	300897	山科智能	800	23,320.00	0.04
482	603331	百达精工	1,900	23,180.00	0.04
483	002963	豪尔赛	1,900	23,142.00	0.04
484	605296	神农集团	900	23,139.00	0.04
485	300882	万胜智能	1,600	22,784.00	0.04
486	600714	金瑞矿业	1,800	22,590.00	0.04
487	300936	中英科技	800	22,456.00	0.04
488	603630	拉芳家化	1,600	22,416.00	0.04
489	300576	容大感光	800	22,328.00	0.04
490	002004	华邦健康	4,000	22,320.00	0.04
491	000409	云鼎科技	4,100	22,263.00	0.04

492	000411	英特集团	2,100	22,197.00	0.04
493	300599	雄塑科技	2,600	22,126.00	0.04
494	603958	哈森股份	3,600	22,032.00	0.04
495	603836	海程邦达	1,200	22,008.00	0.04
496	300140	中环装备	3,200	21,920.00	0.04
497	301037	保立佳	1,000	21,840.00	0.04
498	603221	爱丽家居	2,700	21,600.00	0.04
499	603098	森特股份	600	21,516.00	0.04
500	002862	实丰文化	1,900	21,413.00	0.04
501	300153	科泰电源	2,500	21,300.00	0.04
502	300160	秀强股份	2,600	21,138.00	0.04
503	300695	兆丰股份	400	21,024.00	0.03
504	000153	丰原药业	2,500	20,900.00	0.03
505	300813	泰林生物	500	20,345.00	0.03
506	603321	梅轮电梯	3,100	20,181.00	0.03
507	603690	至纯科技	500	20,150.00	0.03
508	002942	新农股份	1,200	20,124.00	0.03
509	603093	南华期货	1,900	20,121.00	0.03
510	300840	酷特智能	2,200	19,910.00	0.03
511	301062	上海艾录	1,700	19,839.00	0.03
512	003008	开普检测	800	19,768.00	0.03
513	301055	张小泉	1,100	19,558.00	0.03
514	603886	元祖股份	1,100	19,382.00	0.03
515	600356	恒丰纸业	2,800	19,236.00	0.03
516	600894	广日股份	2,900	19,227.00	0.03
517	300624	万兴科技	600	19,194.00	0.03
518	605155	西大门	1,300	19,149.00	0.03
519	603012	创力集团	3,200	18,912.00	0.03
520	002560	通达股份	3,100	18,445.00	0.03
521	002947	恒铭达	1,000	18,400.00	0.03
522	003010	若羽臣	1,100	17,875.00	0.03
523	603168	莎普爱思	2,100	17,661.00	0.03
524	605077	华康股份	800	17,640.00	0.03
525	002985	北摩高科	300	17,574.00	0.03
526	605001	威奥股份	2,700	17,334.00	0.03
527	601609	金田铜业	2,300	17,273.00	0.03
528	600956	新天绿能	1,400	17,248.00	0.03
529	300955	嘉亨家化	700	17,164.00	0.03
530	002441	众业达	1,800	16,956.00	0.03

531	000541	佛山照明	3,300	16,929.00	0.03
532	301068	大地海洋	700	16,905.00	0.03
533	301080	百普赛斯	100	16,689.00	0.03
534	002982	湘佳股份	400	16,472.00	0.03
535	603536	惠发食品	2,200	16,368.00	0.03
536	603861	白云电器	2,000	16,300.00	0.03
537	301045	天禄科技	700	16,149.00	0.03
538	300949	奥雅股份	400	15,932.00	0.03
539	002972	科安达	900	15,471.00	0.03
540	002641	公元股份	3,200	15,424.00	0.03
541	300265	通光线缆	1,700	14,960.00	0.02
542	300492	华图山鼎	400	14,856.00	0.02
543	300442	普丽盛	300	14,766.00	0.02
544	600594	益佰制药	2,600	14,560.00	0.02
545	601877	正泰电器	400	14,312.00	0.02
546	603999	读者传媒	2,700	14,283.00	0.02
547	300218	安利股份	1,000	14,270.00	0.02
548	002889	东方嘉盛	600	14,196.00	0.02
549	300190	维尔利	3,000	14,070.00	0.02
550	603660	苏州科达	2,400	13,824.00	0.02
551	001209	洪兴股份	900	13,698.00	0.02
552	301008	宏昌科技	500	13,515.00	0.02
553	600676	交运股份	3,200	13,440.00	0.02
554	300425	中建环能	2,800	13,384.00	0.02
555	003000	劲仔食品	1,500	13,350.00	0.02
556	001206	依依股份	400	13,260.00	0.02
557	002976	瑞玛精密	600	12,924.00	0.02
558	002223	鱼跃医疗	500	12,830.00	0.02
559	603200	上海洗霸	900	12,735.00	0.02
560	603800	道森股份	500	12,715.00	0.02
561	002093	国脉科技	2,200	12,562.00	0.02
562	300929	华骐环保	900	12,375.00	0.02
563	603383	顶点软件	500	12,345.00	0.02
564	300448	浩云科技	2,300	12,328.00	0.02
565	603687	大胜达	1,300	12,116.00	0.02
566	300789	唐源电气	600	12,102.00	0.02
567	002849	威星智能	1,000	11,930.00	0.02
568	003043	华亚智能	200	11,908.00	0.02
569	600249	两面针	2,300	11,845.00	0.02

570	601011	宝泰隆	2,700	11,286.00	0.02
571	600120	浙江东方	2,800	11,228.00	0.02
572	603949	雪龙集团	400	10,968.00	0.02
573	603679	华体科技	1,000	10,960.00	0.02
574	002596	海南瑞泽	3,200	10,912.00	0.02
575	002826	易明医药	1,100	10,736.00	0.02
576	603021	山东华鹏	2,100	10,731.00	0.02
577	300920	润阳科技	500	10,680.00	0.02
578	300272	开能健康	1,800	10,620.00	0.02
579	300381	溢多利	1,000	10,410.00	0.02
580	300040	九洲集团	1,400	10,108.00	0.02
581	300402	宝色股份	500	10,075.00	0.02
582	300958	建工修复	500	9,890.00	0.02
583	002899	英派斯	800	9,808.00	0.02
584	300235	方直科技	900	9,639.00	0.02
585	300901	中胤时尚	1,000	9,410.00	0.02
586	300664	鹏鹞环保	1,700	9,350.00	0.02
587	300433	蓝思科技	800	8,856.00	0.01
588	603661	恒林股份	200	8,526.00	0.01
589	300594	朗进科技	500	8,500.00	0.01
590	600612	老凤祥	200	8,356.00	0.01
591	603278	大业股份	1,000	8,330.00	0.01
592	603909	建发合诚	600	8,262.00	0.01
593	300561	汇金科技	800	8,240.00	0.01
594	001217	华尔泰	600	8,124.00	0.01
595	002910	庄园牧场	700	8,008.00	0.01
596	603709	中源家居	500	7,970.00	0.01
597	603380	易德龙	200	7,780.00	0.01
598	300106	西部牧业	800	7,432.00	0.01
599	600292	远达环保	1,200	7,416.00	0.01
600	601388	怡球资源	2,100	7,350.00	0.01
601	600539	狮头股份	1,100	7,051.00	0.01
602	603118	共进股份	900	6,678.00	0.01
603	300057	万顺新材	700	6,629.00	0.01
604	603578	三星新材	500	6,610.00	0.01
605	603390	通达电气	800	6,520.00	0.01
606	603956	威派格	600	6,510.00	0.01
607	002449	国星光电	800	6,472.00	0.01
608	300553	集智股份	200	6,298.00	0.01

609	002266	浙富控股	1,300	6,227.00	0.01
610	002521	齐峰新材	1,100	5,907.00	0.01
611	603980	吉华集团	1,100	5,797.00	0.01
612	300063	天龙集团	1,400	5,600.00	0.01
613	002622	融钰集团	1,700	5,440.00	0.01
614	600080	金花股份	700	5,334.00	0.01
615	300513	恒实科技	500	5,210.00	0.01
616	601598	中国外运	1,300	5,044.00	0.01
617	003016	欣贺股份	600	5,040.00	0.01
618	600114	东睦股份	600	4,788.00	0.01
619	600421	华嵘控股	400	4,356.00	0.01
620	002543	万和电气	600	4,212.00	0.01
621	600851	海欣股份	600	4,188.00	0.01
622	002295	精艺股份	600	3,990.00	0.01
623	002678	珠江钢琴	600	3,486.00	0.01
624	301059	金三江	200	3,360.00	0.01
625	603966	法兰泰克	300	3,180.00	0.01
626	300674	宇信科技	200	3,136.00	0.01
627	300279	和晶科技	500	2,965.00	0.00
628	601999	出版传媒	400	2,360.00	0.00
629	600452	涪陵电力	200	2,322.00	0.00
630	605500	森林包装	100	1,631.00	0.00
631	000407	胜利股份	400	1,488.00	0.00
632	605218	伟时电子	100	1,255.00	0.00
633	002830	名雕股份	100	1,061.00	0.00
634	600423	柳化股份	200	750.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603026	石大胜华	3,249,072.00	7.60
2	600362	江西铜业	2,554,372.00	5.98
3	002326	永太科技	2,387,962.00	5.59
4	002585	双星新材	2,266,033.17	5.30
5	600641	万业企业	1,981,372.00	4.64

6	002821	凯莱英	1,858,540.00	4.35
7	601137	博威合金	1,744,815.57	4.08
8	600223	鲁商发展	1,731,070.00	4.05
9	600782	新钢股份	1,705,494.00	3.99
10	605358	立昂微	1,682,963.00	3.94
11	300212	易华录	1,664,515.00	3.90
12	300769	德方纳米	1,651,556.00	3.87
13	600110	诺德股份	1,641,198.00	3.84
14	300077	国民技术	1,603,767.00	3.75
15	300450	先导智能	1,559,503.00	3.65
16	603897	长城科技	1,513,423.00	3.54
17	600011	华能国际	1,492,049.00	3.49
18	000959	首钢股份	1,486,663.00	3.48
19	600338	西藏珠峰	1,473,486.00	3.45
20	000537	广宇发展	1,461,046.00	3.42
21	002011	盾安环境	1,445,146.00	3.38
22	603997	继峰股份	1,415,952.00	3.31
23	600418	江淮汽车	1,386,157.00	3.24
24	002531	天顺风能	1,373,377.00	3.21
25	002756	永兴材料	1,362,736.00	3.19
26	603290	斯达半导	1,356,570.00	3.17
27	300151	昌红科技	1,340,179.00	3.14
28	600201	生物股份	1,339,177.00	3.13
29	000831	五矿稀土	1,272,952.00	2.98
30	002432	九安医疗	1,244,355.00	2.91
31	600256	广汇能源	1,244,143.00	2.91
32	600577	精达股份	1,228,795.00	2.88
33	002074	国轩高科	1,219,654.00	2.85
34	300731	科创新源	1,219,520.00	2.85
35	000503	国新健康	1,215,783.00	2.85
36	603960	克来机电	1,211,217.00	2.83
37	300433	蓝思科技	1,190,266.00	2.79
38	600339	中油工程	1,168,761.00	2.74
39	300745	欣锐科技	1,161,594.00	2.72
40	002625	光启技术	1,153,224.00	2.70
41	000681	视觉中国	1,149,803.00	2.69

42	600399	抚顺特钢	1,147,698.00	2.69
43	601126	四方股份	1,135,520.00	2.66
44	002886	沃特股份	1,132,920.00	2.65
45	601225	陕西煤业	1,129,087.00	2.64
46	002906	华阳集团	1,124,598.00	2.63
47	603738	泰晶科技	1,122,784.24	2.63
48	300219	鸿利智汇	1,120,994.00	2.62
49	300116	保力新	1,120,303.00	2.62
50	300472	新元科技	1,114,649.00	2.61
51	601633	长城汽车	1,110,443.00	2.60
52	300546	雄帝科技	1,109,914.00	2.60
53	300383	光环新网	1,100,605.00	2.58
54	601857	中国石油	1,098,193.00	2.57
55	002128	电投能源	1,096,837.00	2.57
56	600085	同仁堂	1,085,666.00	2.54
57	002812	恩捷股份	1,083,025.00	2.53
58	300618	寒锐钴业	1,077,830.00	2.52
59	603260	合盛硅业	1,069,985.00	2.50
60	000762	西藏矿业	1,057,581.00	2.48
61	605376	博迁新材	1,056,478.00	2.47
62	600210	紫江企业	1,051,073.00	2.46
63	002284	亚太股份	1,047,837.00	2.45
64	600704	物产中大	1,036,401.00	2.43
65	300759	康龙化成	1,023,842.00	2.40
66	000982	中银绒业	1,019,476.00	2.39
67	002402	和而泰	1,015,426.00	2.38
68	601898	中煤能源	1,012,703.00	2.37
69	600111	北方稀土	1,000,480.00	2.34
70	300457	赢合科技	998,092.00	2.34
71	600348	华阳股份	990,559.00	2.32
72	300072	海新能科	989,031.00	2.31
73	600699	均胜电子	985,796.00	2.31
74	600114	东睦股份	985,403.00	2.31
75	002044	美年健康	978,393.00	2.29
76	300750	宁德时代	974,665.00	2.28
77	300055	万邦达	968,138.00	2.27

78	300657	弘信电子	960,285.00	2.25
79	002171	楚江新材	959,597.00	2.25
80	002459	晶澳科技	957,525.00	2.24
81	601600	中国铝业	956,033.00	2.24
82	002472	双环传动	953,971.00	2.23
83	000821	京山轻机	952,162.00	2.23
84	002371	北方华创	950,569.00	2.22
85	300552	万集科技	941,472.00	2.20
86	000423	东阿阿胶	930,420.00	2.18
87	601088	中国神华	925,139.00	2.17
88	603693	江苏新能	924,628.10	2.16
89	600516	方大炭素	924,251.49	2.16
90	000949	新乡化纤	923,693.00	2.16
91	300226	上海钢联	920,940.00	2.16
92	603160	汇顶科技	916,295.00	2.14
93	000823	超声电子	916,285.00	2.14
94	300872	天阳科技	913,000.60	2.14
95	603917	合力科技	912,896.00	2.14
96	002655	共达电声	907,770.00	2.12
97	600529	山东药玻	901,804.00	2.11
98	300490	华自科技	901,718.00	2.11
99	300320	海达股份	901,638.00	2.11
100	300896	爱美客	901,515.00	2.11
101	300261	雅本化学	896,092.00	2.10
102	300168	万达信息	892,209.00	2.09
103	300471	厚普股份	888,970.00	2.08
104	300655	晶瑞电材	881,657.00	2.06
105	300331	苏大维格	878,435.09	2.06
106	300253	卫宁健康	878,101.00	2.06
107	002008	大族激光	871,754.00	2.04
108	000898	鞍钢股份	870,086.00	2.04
109	002505	鹏都农牧	869,263.00	2.03
110	600688	上海石化	869,245.00	2.03
111	002036	联创电子	868,648.00	2.03
112	002483	润邦股份	862,219.36	2.02
113	600773	西藏城投	859,128.00	2.01

114	603501	韦尔股份	857,501.00	2.01
-----	--------	------	------------	------

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

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	603026	石大胜华	3,204,899.00	7.50
2	600362	江西铜业	2,490,487.00	5.83
3	002326	永太科技	2,427,210.00	5.68
4	002585	双星新材	2,273,076.00	5.32
5	600641	万业企业	2,004,999.00	4.69
6	600782	新钢股份	1,724,311.00	4.04
7	600223	鲁商发展	1,723,099.00	4.03
8	601137	博威合金	1,676,208.00	3.92
9	300769	德方纳米	1,658,608.00	3.88
10	600110	诺德股份	1,656,386.00	3.88
11	300450	先导智能	1,650,298.00	3.86
12	605358	立昂微	1,632,541.00	3.82
13	300077	国民技术	1,616,137.00	3.78
14	300212	易华录	1,597,021.00	3.74
15	600011	华能国际	1,524,229.00	3.57
16	000537	广宇发展	1,523,653.00	3.57
17	000959	首钢股份	1,490,804.00	3.49
18	600338	西藏珠峰	1,478,722.00	3.46
19	002756	永兴材料	1,434,496.00	3.36
20	603897	长城科技	1,428,602.00	3.34
21	300151	昌红科技	1,403,914.00	3.29
22	603290	斯达半导	1,389,510.00	3.25
23	002011	盾安环境	1,383,878.00	3.24
24	600418	江淮汽车	1,369,358.00	3.20
25	002531	天顺风能	1,336,583.00	3.13
26	603997	继峰股份	1,335,606.00	3.13
27	000831	五矿稀土	1,307,672.00	3.06
28	600256	广汇能源	1,282,396.00	3.00
29	002074	国轩高科	1,268,093.00	2.97
30	002821	凯莱英	1,253,171.00	2.93
31	300731	科创新源	1,249,856.00	2.93

32	603960	克来机电	1,235,838.00	2.89
33	000503	国新健康	1,227,895.00	2.87
34	300546	雄帝科技	1,215,874.00	2.85
35	300433	蓝思科技	1,197,144.00	2.80
36	002625	光启技术	1,183,229.36	2.77
37	600339	中油工程	1,172,794.00	2.74
38	300745	欣锐科技	1,170,652.00	2.74
39	600399	抚顺特钢	1,166,125.00	2.73
40	600577	精达股份	1,154,771.00	2.70
41	601225	陕西煤业	1,153,569.00	2.70
42	002906	华阳集团	1,145,419.20	2.68
43	002886	沃特股份	1,141,988.00	2.67
44	002432	九安医疗	1,141,422.00	2.67
45	300383	光环新网	1,126,195.00	2.64
46	002812	恩捷股份	1,121,080.00	2.62
47	300472	新元科技	1,120,578.00	2.62
48	600085	同仁堂	1,112,722.00	2.60
49	002128	电投能源	1,110,848.00	2.60
50	002402	和而泰	1,106,317.00	2.59
51	601857	中国石油	1,105,484.00	2.59
52	300618	寒锐钴业	1,099,803.00	2.57
53	601633	长城汽车	1,097,694.00	2.57
54	300219	鸿利智汇	1,095,551.00	2.56
55	000681	视觉中国	1,083,756.00	2.54
56	002284	亚太股份	1,080,357.00	2.53
57	603738	泰晶科技	1,077,018.14	2.52
58	603260	合盛硅业	1,059,108.00	2.48
59	300457	赢合科技	1,049,620.00	2.46
60	605376	博迁新材	1,046,820.00	2.45
61	000762	西藏矿业	1,043,741.00	2.44
62	601126	四方股份	1,040,570.00	2.44
63	600111	北方稀土	1,033,984.00	2.42
64	300759	康龙化成	1,025,693.00	2.40
65	601898	中煤能源	1,016,374.00	2.38
66	300072	海新能科	1,015,401.00	2.38
67	600704	物产中大	1,007,122.00	2.36
68	000982	中银绒业	1,005,295.00	2.35
69	600210	紫江企业	1,005,117.00	2.35

70	002044	美年健康	991,146.00	2.32
71	600114	东睦股份	985,501.00	2.31
72	600699	均胜电子	976,601.00	2.29
73	601600	中国铝业	974,810.00	2.28
74	300657	弘信电子	973,935.00	2.28
75	300552	万集科技	973,290.00	2.28
76	300055	万邦达	972,309.00	2.28
77	002171	楚江新材	967,720.00	2.26
78	300750	宁德时代	964,955.00	2.26
79	002472	双环传动	957,326.00	2.24
80	601088	中国神华	949,132.00	2.22
81	300471	厚普股份	938,357.00	2.20
82	300896	爱美客	937,154.00	2.19
83	300490	华自科技	936,102.00	2.19
84	000821	京山轻机	934,226.00	2.19
85	600529	山东药玻	930,709.00	2.18
86	603693	江苏新能	930,537.36	2.18
87	000423	东阿阿胶	926,695.00	2.17
88	002371	北方华创	925,589.00	2.17
89	600201	生物股份	925,140.00	2.17
90	002280	联络互动	923,422.00	2.16
91	002036	联创电子	912,832.00	2.14
92	603160	汇顶科技	911,370.00	2.13
93	300655	晶瑞电材	904,720.00	2.12
94	300320	海达股份	901,842.00	2.11
95	002655	共达电声	901,584.00	2.11
96	300331	苏大维格	900,595.10	2.11
97	603917	合力科技	896,346.00	2.10
98	300081	恒信东方	893,670.00	2.09
99	300393	中来股份	890,075.00	2.08
100	002008	大族激光	889,610.00	2.08
101	600348	华阳股份	889,125.00	2.08
102	300751	迈为股份	884,027.00	2.07
103	000949	新乡化纤	880,945.00	2.06
104	603650	彤程新材	880,152.00	2.06
105	300474	景嘉微	875,892.00	2.05
106	002456	欧菲光	871,654.00	2.04
107	002483	润邦股份	871,378.00	2.04

108	300620	光库科技	869,395.00	2.03
109	002123	梦网科技	867,194.00	2.03
110	002850	科达利	860,046.00	2.01
111	603501	韦尔股份	859,840.00	2.01
112	300168	万达信息	858,755.00	2.01
113	300390	天华超净	855,913.00	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	773,507,472.99
卖出股票收入（成交）总额	751,593,850.92

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	2,313,241.95	3.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,313,241.95	3.84

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	019658	21 国债 10	22,700	2,313,241.95	3.84

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票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	130,128.93
2	应收清算款	1,016,689.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	85,044.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,231,862.56

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

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
2,529	19,972.42	21,487,521.25	42.54%	29,022,719.83	57.46%

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	229,726.14	0.4548%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 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	37,315,963.00
本报告期基金总申购份额	26,869,632.31
减：本报告期基金总赎回份额	13,675,354.23
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	50,510,241.08

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

本报告期内无涉及本基金管理人、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，本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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	449,019,845.32	29.44%	328,370.14	27.58%	-
中信证券	1	375,891,279.65	24.65%	350,074.38	29.41%	-
天风证券	1	235,529,776.42	15.44%	172,243.73	14.47%	-
恒泰证券	1	211,406,945.40	13.86%	154,603.65	12.99%	-
华创证券	1	88,377,779.92	5.80%	64,631.10	5.43%	-
国盛证券	1	87,896,360.12	5.76%	64,278.84	5.40%	-
招商证券	1	76,847,822.10	5.04%	56,200.09	4.72%	-

东方财富证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

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。

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	-	-	86,208,000.00	13.43%	-	-

中信证券	-	-	292,300,000.00	45.55%	-	-
天风证券	-	-	109,393,000.00	17.05%	-	-
恒泰证券	-	-	29,848,000.00	4.65%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	73,200,000.00	11.41%	-	-
招商证券	2,305,859.78	100.00%	50,800,000.00	7.92%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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 2021 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 21 日
2	《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
3	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 29 日
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（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日
5	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日
6	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 30 日

7	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 22 日
8	《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
9	《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
10	《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

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022 年 1 月 13 日-2022 年 6 月 30 日	-	17,231,604.34	-	17,231,604.34	34.12%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

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

2022 年 8 月 30 日