

# 国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	95
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	96
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	96
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	96
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	96
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	96
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	96
8.12 投资组合报告附注 .....	96
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>97</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	97
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	97
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	97
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	98
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>98</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>98</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	98
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	98
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	99
11.4 基金投资策略的改变 .....	99
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	99
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	99
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	99
11.8 其他重大事件 .....	103
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>104</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	104
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	104
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>105</b>
13.1 备查文件目录 .....	105
13.2 存放地点 .....	105
13.3 查阅方式 .....	105

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	国金量化多因子	
基金主代码	006195	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年10月31日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,164,255,332.81份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
下属分级基金的交易代码	006195	016858
报告期末下属分级基金的份额总额	1,082,806,724.97份	1,081,448,607.84份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、量化选股模型、债券等固定收益类资产投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略。</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。量化选股模型包括，多因子选股策略、统计套利策略、事件驱动套利策略、投资组合优化。</p> <p>本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。</p>
业绩比较基准	85%×中证 500 指数收益率+15%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞志海	许俊
	联系电话	010-88005852	010-66596688
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4000-2000-18	95566

传真	010-88005666	010-66594942
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100026	100818
法定代表人	邵海波	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
本期已实现收益	956,632,803.78	899,066,523.34	877,466,013.96	501,029,274.81	312,050,368.06	132,875,185.27
本期利润	1,003,718,971.82	880,226,702.03	745,571,594.00	565,429,017.40	287,885,578.93	87,196,769.42
加权平均基金份额本期利润	0.9451	1.0424	-0.4565	-0.6886	0.1252	0.0572
本期加权平均净值利润率	37.85%	40.04%	-24.81%	-37.58%	6.10%	2.79%
本期基金份额净值增长率	48.48%	47.89%	-3.29%	-3.68%	13.68%	13.24%

3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	期末可供分配利润	1,836,123,241.27	1,749,698,715.36	939,604,794.59	320,723,153.71	3,184,308,783.07
期末可供分配基金份额利润	1.6957	1.6179	0.7977	0.7395	1.0953	1.0631
期末基金资产净值	3,257,758,858.40	3,213,107,698.32	2,386,628,891.48	871,332,755.94	6,091,584,729.20	4,104,133,966.05
期末基金份额净值	3.0086	2.9711	2.0263	2.0090	2.0953	2.0858
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	基金份额累计净值增长率	200.86%	71.00%	102.63%	15.63%	109.53%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多因子 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.43%	1.37%	0.75%	1.05%	1.68%	0.32%
过去六个月	23.71%	1.19%	21.92%	0.99%	1.79%	0.20%
过去一年	48.48%	1.16%	25.75%	1.07%	22.73%	0.09%
过去三年	63.23%	1.38%	26.54%	1.16%	36.69%	0.22%
过去五年	116.91%	1.31%	20.12%	1.10%	96.79%	0.21%

自基金合同生效起至今	200.86%	1.28%	74.89%	1.17%	125.97%	0.11%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

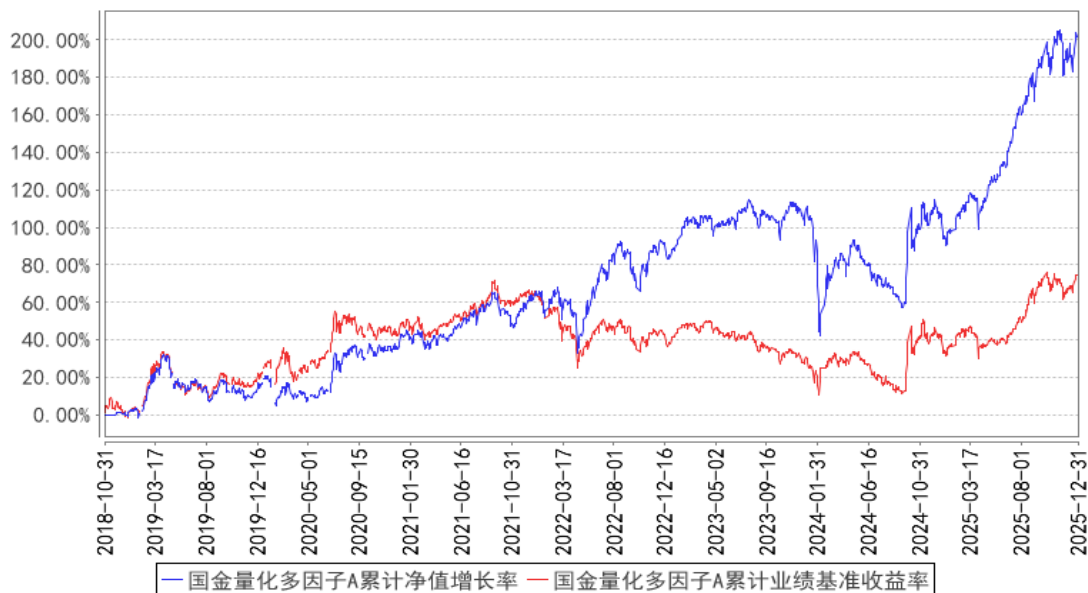
国金量化多因子 C

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
过去三个月	2.33%	1.37%	0.75%	1.05%	1.58%	0.32%
过去六个月	23.46%	1.19%	21.92%	0.99%	1.54%	0.20%
过去一年	47.89%	1.16%	25.75%	1.07%	22.14%	0.09%
过去三年	61.30%	1.38%	26.54%	1.16%	34.76%	0.22%
自基金合同生效起至今	71.00%	1.35%	27.15%	1.14%	43.85%	0.21%

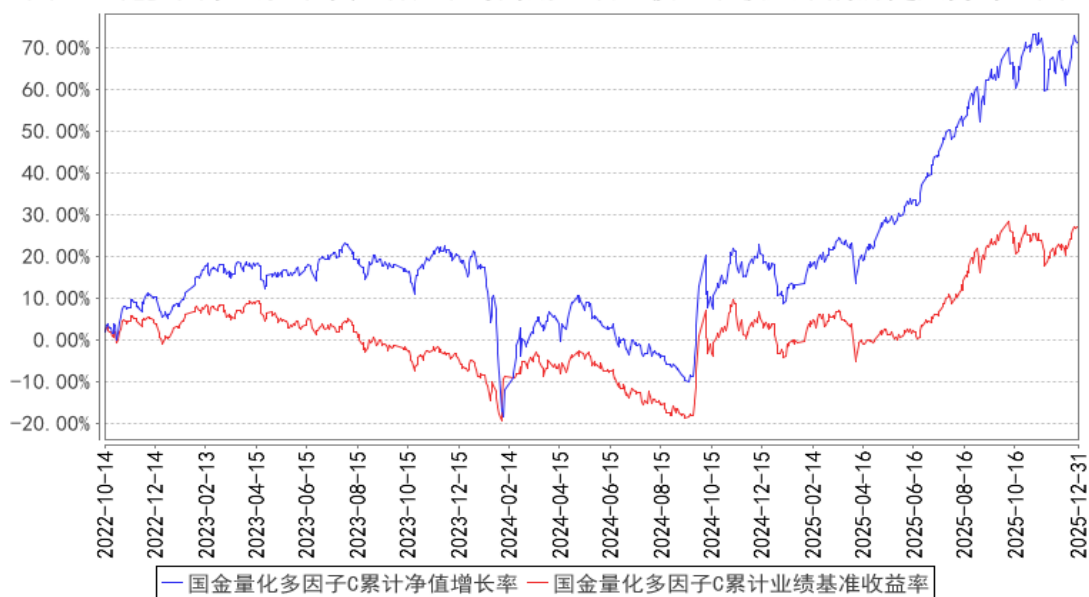
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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

国金量化多因子A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



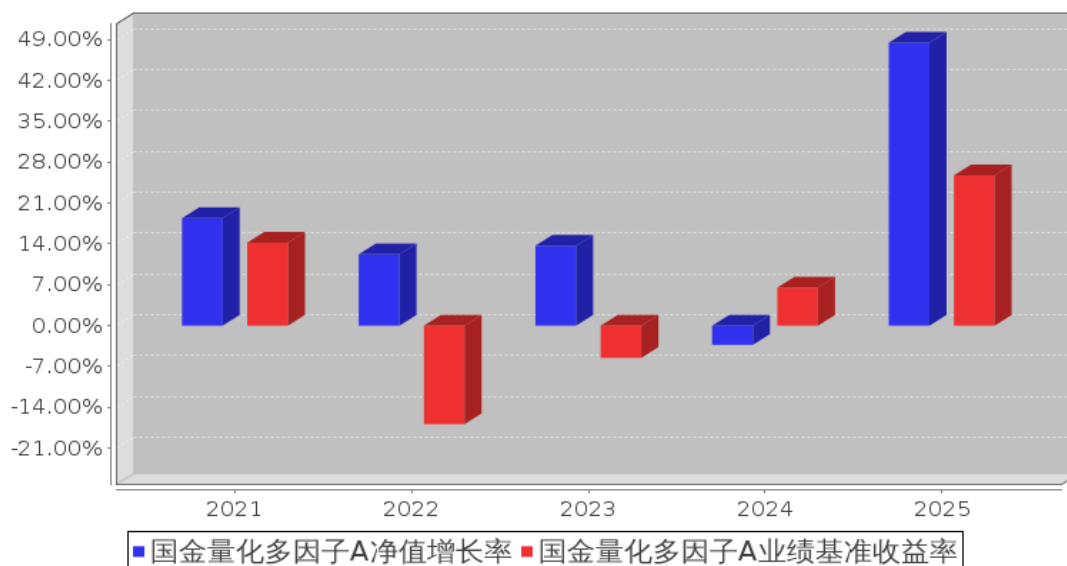
国金量化多因子C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



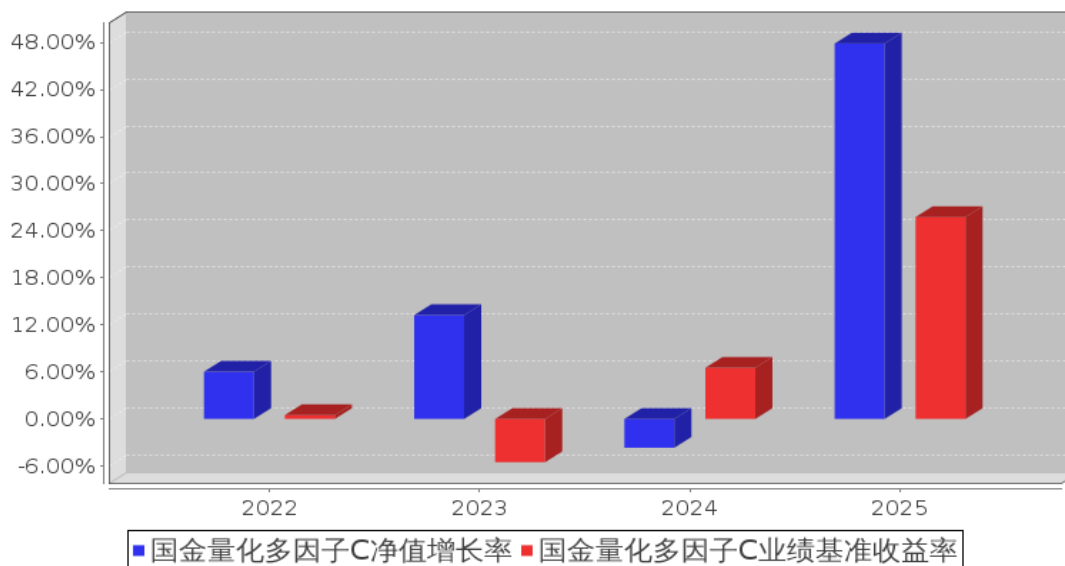
注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，图示日期为 2018 年 10 月 31 日至 2025 年 12 月 31 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2022 年 10 月 14 日，图示日期为 2022 年 10 月 14 日至 2025 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多因子A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国金量化多因子C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

### 3.3 其他指标

无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2025 年 12 月 31 日，国金基金管理有限公司共管理 33 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证

券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金、国金中证 A500 指数增强型证券投资基金、国金安瑞平衡混合型证券投资基金、国金红利量化选股混合型证券投资基金、国金中证全指指数增强型证券投资基金、国金安和债券型证券投资基金、国金智远量化选股混合型证券投资基金、国金科创业量化选股股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2020 年 9 月 3 日	-	9 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资中心副总经理。
姚加红	本基金的基金经理	2023 年 1 月 5 日	-	21 年	姚加红先生，北京航空航天大学硕士。2004 年 4 月至 2011 年 5 月在博时基金管理有限公司任信息技术部高级程序员。2011 年 6 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部总经理、指数投资事业部副总经理，现任量化投资中心总经理。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
姚加红	公募基金	4	15,331,038,656.18	2023年1月5日
	私募资产管理计划	5	370,357,194.43	2016年4月15日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	15,701,395,850.61	-

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

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统等对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任专户资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管

理的多个投资组合投资交易行为加强管理、监控和分析，防范不公平交易。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，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

2025 年的市场环境呈现以下特征：市场风格方面，主要市场风格因子的波动幅度较 2024 年同期有所收窄，但较高波动行情的出现频率与 2024 年相当，贝塔值、动量和市值等风格因子在 2025 年内波动较大；市场活跃度方面，2025 年下半年整体高于上半年，市场活跃度的峰值水平与 2024 年四季度相当；行业表现方面，大部分中信一级行业在报告期内录得正收益，其中涨幅居前的行业为有色金属、通信、电子，而食品饮料、煤炭则出现下跌，行业最大跌幅超过 6%。

报告期内，本基金超额收益的波动率低于历史均值，较为严格的风险约束一定程度上提升了超额收益的稳定性。随着机构投资者占比持续提升、投资方法论不断演进，各类飞速发展的计算机技术和人工智能模型为资产管理提供更为高效的工具，市场有效性的提升是大势所趋。在这一过程中，风险模型的成熟度要求相应提高，这也是国金量化模型持续迭代优化的重要方向之一。

报告期内，本基金的风险收益特征整体符合预期。2025 年，中证 500 指数表现相对强势，尤其在指数权重股大幅拉升的结构性行情中，对标该指数的产品在获取稳定超额收益方面面临一定挑战。国金量化策略凭借其收益来源多样化与持仓高度分散化的特点，始终坚持在有效控制风险的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

#### 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 3.0086 元，累计单位净值为 3.0086 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 48.48%，同期业绩比较基准增长率为 25.75%。

本基金 C 类份额单位净值为 2.9711 元，累计单位净值为 2.9711 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 47.89%，同期业绩比较基准增长率为 25.75%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，A 股市场出现巨幅波动的概率或将降低，但风格切换与行业轮动速度较快的特征可能仍将延续。在此背景下，以获取相对稳定超额收益为目标的公募量化多头产品需保持较为严格的风险控制，并持续优化风险模型，增强对市场风险的刻画能力，进一步提升超额收益的稳

健性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况及时制定相关管理制度，细化管理流程，并持续更新和完善，本基金管理人制定的规章制度涵盖公司主要业务范围。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2026)审字第 70015670_A14 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金量化多因子股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金量化多因子股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金量化多因子股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化多因子股票</p>

	<p>型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化多因子股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国金量化多因子股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金量化多因子股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>贺耀   王蕊</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2026 年 3 月 31 日</p>

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	450,135,919.89	200,028,445.58
结算备付金		59,188,754.84	17,820,121.14
存出保证金		1,290,429.58	1,048,245.49
交易性金融资产	7.4.7.2	5,931,419,455.73	2,900,625,370.54
其中：股票投资		5,931,419,455.73	2,900,625,370.54
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	85,065,075.15	172,837,240.57
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		75,086,452.26	8,794,623.31
应收股利		-	-
应收申购款		15,851,370.51	2,840,202.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	1,973.17
资产总计		6,618,037,457.96	3,303,996,222.19
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		62,824,402.69	4,148,987.80
应付赎回款		50,925,581.27	18,615,597.63

应付管理人报酬		6,667,669.70	3,515,497.79
应付托管费		1,111,278.30	585,916.32
应付销售服务费		1,118,335.94	325,335.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	24,523,633.34	18,843,239.43
负债合计		147,170,901.24	46,034,574.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,164,255,332.81	1,611,553,412.03
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	4,306,611,223.91	1,646,408,235.39
净资产合计		6,470,866,556.72	3,257,961,647.42
负债和净资产总计		6,618,037,457.96	3,303,996,222.19

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，国金量化多因子 A 基金份额净值 3.0086 元，基金份额总额 1,082,806,724.97 份；国金量化多因子 C 基金份额净值 2.9711 元，基金份额总额 1,081,448,607.84 份。国金量化多因子份额总额合计为 2,164,255,332.81 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		1,960,155,995.82	-1,241,719,897.07
1. 利息收入		3,213,390.99	1,595,061.30
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,388,689.83	1,265,413.39
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		1,824,701.16	329,647.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		1,921,091,353.27	-1,317,391,526.80
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,862,114,454.48	-1,390,715,213.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	3,830,689.16
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	58,976,898.79	69,492,997.20
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	28,246,346.73	67,494,677.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	7,604,904.83	6,581,891.06
<b>减：二、营业总支出</b>		76,210,321.97	69,280,714.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	57,678,854.62	54,009,111.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,613,142.47	9,001,518.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	8,653,954.81	6,007,859.02
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	264,370.07	262,224.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,883,945,673.85	-1,311,000,611.40
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,883,945,673.85	-1,311,000,611.40
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,883,945,673.85	-1,311,000,611.40

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	1,611,553,412.03	-	1,646,408,235.39	3,257,961,647.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,611,553,412.03	-	1,646,408,235.39	3,257,961,647.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	552,701,920.78	-	2,660,202,988.52	3,212,904,909.30
(一)、综合收益总额	-	-	1,883,945,673.85	1,883,945,673.85
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	552,701,920.78	-	776,257,314.67	1,328,959,235.45
其中：1. 基金申购款	3,021,116,314.64	-	4,616,943,164.83	7,638,059,479.47
2. 基金赎回款	-2,468,414,393.86	-	-3,840,685,850.16	-6,309,100,244.02
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,164,255,332.81	-	4,306,611,223.91	6,470,866,556.72
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,874,956,466. 52	-	5,320,762,228. 73	10,195,718,695. 25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,874,956,466. 52	-	5,320,762,228. 73	10,195,718,695. 25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 3,263,403,054. 49	-	- 3,674,353,993. 34	- 6,937,757,047.8 3
(一)、综合收益总额	-	-	- 1,311,000,611. 40	- 1,311,000,611.4 0
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 3,263,403,054. 49	-	- 2,363,353,381. 94	- 5,626,756,436.4 3
其中：1. 基金申购款	1,567,807,177. 76	-	1,389,355,874. 04	2,957,163,051.8 0
2. 基金赎回款	- 4,831,210,232. 25	-	- 3,752,709,255. 98	- 8,583,919,488.2 3
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,611,553,412.	-	1,646,408,235.	3,257,961,647.4

资产	03		39	2
----	----	--	----	---

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

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

### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 7.4.4.12 外币交易

无

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

##### 7.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

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

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	450,135,919.89	200,028,445.58
等于：本金	450,086,884.12	200,005,465.29
加：应计利息	49,035.77	22,980.29
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	450,135,919.89	200,028,445.58

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,969,071,077.84	-	5,931,419,455.73	-37,651,622.11
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		5,969,071,077.84	-	5,931,419,455.73	-37,651,622.11
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,966,523,339.38	-	2,900,625,370.54	-65,897,968.84
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		2,966,523,339.38	-	2,900,625,370.54	-65,897,968.84

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	85,065,075.15	-
银行间市场	-	-
合计	85,065,075.15	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	172,837,240.57	-
银行间市场	-	-
合计	172,837,240.57	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	1,973.17
待摊费用	-	-
合计	-	1,973.17

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	21,597.22	2,767.93
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	24,422,536.12	18,750,471.50
其中：交易所市场	24,422,536.12	18,750,471.50
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	79,500.00	90,000.00
合计	24,523,633.34	18,843,239.43

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 国金量化多因子 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,177,839,970.30	1,177,839,970.30
本期申购	1,013,290,434.11	1,013,290,434.11
本期赎回（以“-”号填列）	-1,108,323,679.44	-1,108,323,679.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,082,806,724.97	1,082,806,724.97

## 国金量化多因子 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	433,713,441.73	433,713,441.73
本期申购	2,007,825,880.53	2,007,825,880.53
本期赎回（以“-”号填列）	-1,360,090,714.42	-1,360,090,714.42
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,081,448,607.84	1,081,448,607.84

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

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 国金量化多因子 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	939,604,794.59	269,184,126.59	1,208,788,921.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	939,604,794.59	269,184,126.59	1,208,788,921.18
本期利润	956,632,803.78	47,086,168.04	1,003,718,971.82
本期基金份额交易产生的变动数	-60,114,357.10	22,558,597.53	-37,555,759.57
其中：基金申购款	1,226,944,712.47	376,334,284.04	1,603,278,996.51
基金赎回款	-1,287,059,069.57	-353,775,686.51	-1,640,834,756.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,836,123,241.27	338,828,892.16	2,174,952,133.43

##### 国金量化多因子 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	320,723,153.71	116,896,160.50	437,619,314.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	320,723,153.71	116,896,160.50	437,619,314.21
本期利润	899,066,523.34	-18,839,821.31	880,226,702.03
本期基金份额交易产生的变动数	529,909,038.31	283,904,035.93	813,813,074.24
其中：基金申购款	2,188,700,476.27	824,963,692.05	3,013,664,168.32
基金赎回款	-1,658,791,437.96	-541,059,656.12	-2,199,851,094.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,749,698,715.36	381,960,375.12	2,131,659,090.48

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31	上年度可比期间 2024年1月1日至2024

	日	年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,204,302.24	771,841.92
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	123,927.31	433,011.19
其他	60,460.28	60,560.28
合计	1,388,689.83	1,265,413.39

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	1,862,114,454.48	-1,390,715,213.16
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	1,862,114,454.48	-1,390,715,213.16

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	36,882,851,587.95	45,287,511,871.86
减：卖出股票成本 总额	34,964,121,112.63	46,612,044,051.38
减：交易费用	56,616,020.84	66,183,033.64
买卖股票差价收 入	1,862,114,454.48	-1,390,715,213.16

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月 31日	2024年1月1日至2024年12月 31日
债券投资收益——利息收入	-	3,106,203.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	724,486.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	3,830,689.16

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	379,617,365.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	373,435,422.00
减：应计利息总额	-	5,457,457.97
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	724,486.00

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股票投资产生的股利收益	58,976,898.79	69,492,997.20
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	58,976,898.79	69,492,997.20

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	28,246,346.73	67,494,677.37
股票投资	28,246,346.73	68,234,035.37
债券投资	-	-739,358.00

资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	28,246,346.73	67,494,677.37

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	7,206,458.07	5,998,285.69
基金转换费收入	398,446.76	583,605.37
合计	7,604,904.83	6,581,891.06

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	75,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	64,870.07	52,224.94
账户维护费	4,500.00	-
合计	264,370.07	262,224.94

#### 7.4.7.24 分部报告

无

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国金证券股份有限公司	2,692,587,212.08	3.60	1,224,793,574.80	1.43

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
国金证券股份有限公司	-	-	241,633,012.80	76.88

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	1,654,800,000.00	5.35	-	-

## 7.4.10.1.4 权证交易

无

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	1,200,627.76	3.60	384,823.83	1.58
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	546,127.21	1.43	-	-

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

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	57,678,854.62	54,009,111.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,212,220.90	18,982,861.94
应支付基金管理人的净管理费	39,466,633.72	35,026,249.77

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,613,142.47	9,001,518.66

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

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
国金基金管理有限公司	-	2,975,038.87	2,975,038.87
国金证券股份有限公司	-	318,575.89	318,575.89
合计	-	3,293,614.76	3,293,614.76
获得销售服务费的各关	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C	合计
国金基金管理有限公司	-	1,103,722.96	1,103,722.96
国金证券股份有限公司	-	351,550.84	351,550.84
合计	-	1,455,273.80	1,455,273.80

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无

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

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

无

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

无

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司-活期存款	450,135,919.89	1,204,302.24	200,028,445.58	771,841.92

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理

组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

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

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

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

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	450,135,919.89	-	-	-	-	-	450,135,919.89
结算备付金	59,188,754.84	-	-	-	-	-	59,188,754.84
存出保证金	1,290,429.58	-	-	-	-	-	1,290,429.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,931,419,455.73	5,931,419,455.73
买入返售金融资产	85,065,075.15	-	-	-	-	-	85,065,075.15
应收申购款	-	-	-	-	-	15,851,370.51	15,851,370.51
应收清算款	-	-	-	-	-	75,086,452.26	75,086,452.26
资产总计	595,680,179.46	-	-	-	-	6,022,357,278.50	6,618,037,457.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	50,925,581.27	50,925,581.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,667,669.70	6,667,669.70
应付托管费	-	-	-	-	-	1,111,278.30	1,111,278.30
应付清算款	-	-	-	-	-	62,824,402.69	62,824,402.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,118,335.94	1,118,335.94
其他负债	-	-	-	-	-	24,523,633.34	24,523,633.34
负债总计	-	-	-	-	-	147,170,901.24	147,170,901.24
利率敏感度缺口	595,680,179.46	-	-	-	-	-5,875,186,377.26	6,470,866,556.72
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	200,028,445.58	-	-	-	-	-	200,028,445.58

结算备付金	17,820,121.14	-	-	-	-	-	17,820,121.14
存出保证金	1,048,245.49	-	-	-	-	-	1,048,245.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-2,900,625,370.54	-	2,900,625,370.54
买入返售金融资产	172,837,240.57	-	-	-	-	-	172,837,240.57
应收清算款	-	-	-	-	-	8,794,623.31	8,794,623.31
应收申购款	-	-	-	-	-	2,840,202.39	2,840,202.39
其他资产	-	-	-	-	-	1,973.17	1,973.17
资产总计	391,734,052.78	-	-	-	-2,912,262,169.41	-	3,303,996,222.19
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	4,148,987.80	4,148,987.80
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,615,597.63	18,615,597.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,515,497.79	3,515,497.79
应付托管费	-	-	-	-	-	585,916.32	585,916.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	325,335.80	325,335.80
其他负债	-	-	-	-	-	18,843,239.43	18,843,239.43
负债总计	-	-	-	-	-	46,034,574.77	46,034,574.77
利率敏感度缺口	391,734,052.78	-	-	-	-2,866,227,594.64	-	3,257,961,647.42

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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	5,931,419,455.73	91.66	2,900,625,370.54	89.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,931,419,455.73	91.66	2,900,625,370.54	89.03

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

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	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 (2025 年 12 月 31 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	+5%	276,133,417.09	132,647,957.69
	-5%	-276,133,417.09	-132,647,957.69

### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

**7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**

**7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	5,931,419,455.73	2,900,625,370.54
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	5,931,419,455.73	2,900,625,370.54

**7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨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。

**7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**

**7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	6,082.14	6,082.14
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,082.14	6,082.14
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	-	-

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

无

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2026 年 3 月 31 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,931,419,455.73	89.63
	其中：股票	5,931,419,455.73	89.63
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	85,065,075.15	1.29
	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	509,324,674.73	7.70
8	其他各项资产	92,228,252.35	1.39
9	合计	6,618,037,457.96	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	30,264,755.04	0.47
B	采矿业	102,140,334.00	1.58
C	制造业	4,479,846,616.82	69.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	160,117,617.60	2.47
E	建筑业	65,288,904.00	1.01
F	批发和零售业	168,721,623.42	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	54,647,785.00	0.84
H	住宿和餐饮业	9,841,280.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	440,389,704.27	6.81
J	金融业	133,359,374.29	2.06
K	房地产业	13,293,806.00	0.21

L	租赁和商务服务业	128,876,929.32	1.99
M	科学研究和技术服务业	34,314,286.50	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	61,552,229.47	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,311,379.00	0.07
Q	卫生和社会工作	5,066,147.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	32,190,300.00	0.50
S	综合	7,196,384.00	0.11
	合计	5,931,419,455.73	91.66

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	301308	江波龙	424,899	104,032,271.16	1.61
2	300058	蓝色光标	8,335,541	96,025,432.32	1.48
3	000338	潍柴动力	4,496,128	77,333,401.60	1.20
4	688472	阿特斯	4,861,921	72,491,242.11	1.12
5	000063	中兴通讯	1,860,700	70,408,888.00	1.09
6	000651	格力电器	1,741,067	70,025,714.74	1.08
7	002384	东山精密	796,306	67,407,302.90	1.04
8	002074	国轩高科	1,708,900	66,835,079.00	1.03
9	300014	亿纬锂能	958,000	62,998,080.00	0.97
10	603228	景旺电子	848,500	62,016,865.00	0.96
11	002466	天齐锂业	1,098,592	60,840,024.96	0.94
12	300073	当升科技	1,046,202	60,470,475.60	0.93
13	300620	光库科技	409,733	60,251,237.65	0.93
14	601360	三六零	5,311,015	59,324,037.55	0.92
15	301358	湖南裕能	853,600	55,193,776.00	0.85
16	600183	生益科技	706,200	50,429,742.00	0.78
17	600089	特变电工	2,265,300	50,334,966.00	0.78
18	001309	德明利	209,500	48,580,955.00	0.75
19	603986	兆易创新	223,500	47,884,875.00	0.74
20	002851	麦格米特	529,691	47,709,268.37	0.74
21	601012	隆基绿能	2,590,530	47,147,646.00	0.73
22	300803	指南针	347,821	45,519,334.27	0.70
23	600487	亨通光电	1,825,100	45,134,723.00	0.70
24	002407	多氟多	1,310,973	44,455,094.43	0.69
25	300570	太辰光	376,460	43,499,953.00	0.67
26	002738	中矿资源	552,421	43,392,669.55	0.67

27	603185	弘元绿能	1,401,299	42,739,619.50	0.66
28	300450	先导智能	847,200	42,343,056.00	0.65
29	600021	上海电力	2,096,200	41,965,924.00	0.65
30	002463	沪电股份	562,803	41,124,015.21	0.64
31	300438	鹏辉能源	720,225	38,330,374.50	0.59
32	603799	华友钴业	521,526	35,599,364.76	0.55
33	002436	兴森科技	1,680,600	35,578,302.00	0.55
34	600926	杭州银行	2,311,002	35,312,110.56	0.55
35	300496	中科创达	481,700	32,514,750.00	0.50
36	002709	天赐材料	674,612	31,254,773.96	0.48
37	002326	永太科技	1,217,800	30,347,576.00	0.47
38	002222	福晶科技	534,200	30,096,828.00	0.47
39	300548	长芯博创	198,500	28,187,000.00	0.44
40	300207	欣旺达	1,073,700	28,077,255.00	0.43
41	300454	深信服	241,823	27,848,336.68	0.43
42	603444	吉比特	65,300	27,677,405.00	0.43
43	601611	中国核建	2,026,000	27,310,480.00	0.42
44	301511	德福科技	746,497	26,717,127.63	0.41
45	300274	阳光电源	151,845	25,971,568.80	0.40
46	300308	中际旭创	40,900	24,949,000.00	0.39
47	002475	立讯精密	430,169	24,394,883.99	0.38
48	300395	菲利华	230,100	23,079,030.00	0.36
49	301171	易点天下	547,600	22,177,800.00	0.34
50	001203	大中矿业	720,900	22,095,585.00	0.34
51	300475	香农芯创	152,305	21,983,703.70	0.34
52	002129	TCL 中环	2,556,989	21,913,395.73	0.34
53	601717	中创智领	888,000	21,800,400.00	0.34
54	300850	新强联	512,100	21,185,577.00	0.33
55	301526	国际复材	2,987,600	20,913,200.00	0.32
56	300655	晶瑞电材	1,206,930	19,467,780.90	0.30
57	603929	亚翔集成	188,600	18,011,300.00	0.28
58	002240	盛新锂能	522,000	17,972,460.00	0.28
59	300033	同花顺	55,000	17,719,900.00	0.27
60	688167	炬光科技	99,619	17,440,298.33	0.27
61	688095	福昕软件	192,634	17,196,437.18	0.27
62	002497	雅化集团	690,000	17,077,500.00	0.26
63	600271	航天信息	1,455,600	17,015,964.00	0.26
64	301095	广立微	224,300	16,084,553.00	0.25
65	300769	德方纳米	365,100	16,068,051.00	0.25
66	000811	冰轮环境	866,500	16,047,580.00	0.25
67	002487	大金重工	305,000	15,838,650.00	0.24
68	000603	盛达资源	506,000	15,665,760.00	0.24
69	002402	和而泰	397,700	15,558,024.00	0.24

70	002812	恩捷股份	274,400	15,542,016.00	0.24
71	600392	盛和资源	714,500	15,383,185.00	0.24
72	000408	藏格矿业	177,200	14,955,680.00	0.23
73	002396	星网锐捷	489,050	14,818,215.00	0.23
74	002371	北方华创	30,254	13,889,006.32	0.21
75	002532	天山铝业	845,200	13,675,336.00	0.21
76	301150	中一科技	324,400	13,621,556.00	0.21
77	300285	国瓷材料	490,700	13,450,087.00	0.21
78	300638	广和通	449,200	13,314,288.00	0.21
79	601869	长飞光纤	111,600	12,985,776.00	0.20
80	002916	深南电路	55,900	12,985,011.00	0.20
81	000555	神州信息	773,400	12,799,770.00	0.20
82	688183	生益电子	133,175	12,743,515.75	0.20
83	301018	申菱环境	196,800	12,500,736.00	0.19
84	000060	中金岭南	2,114,500	12,369,825.00	0.19
85	000733	振华科技	232,311	12,175,419.51	0.19
86	301052	果麦文化	310,000	11,838,900.00	0.18
87	300723	一品红	348,500	11,692,175.00	0.18
88	601233	桐昆股份	656,500	11,298,365.00	0.17
89	603077	和邦生物	4,930,800	11,143,608.00	0.17
90	300418	昆仑万维	265,300	11,063,010.00	0.17
91	000600	建投能源	1,287,700	10,984,081.00	0.17
92	688800	瑞可达	131,406	10,906,698.00	0.17
93	688122	西部超导	144,368	10,766,965.44	0.17
94	603129	春风动力	38,300	10,673,444.00	0.16
95	601615	明阳智能	706,600	10,231,568.00	0.16
96	301292	海科新源	158,600	10,215,426.00	0.16
97	301338	凯格精机	114,700	10,106,217.00	0.16
98	600366	宁波韵升	726,604	10,019,869.16	0.15
99	002192	融捷股份	193,200	9,998,100.00	0.15
100	601128	常熟银行	1,413,939	9,954,130.56	0.15
101	300032	金龙机电	1,821,372	9,780,767.64	0.15
102	600126	杭钢股份	1,185,800	9,676,128.00	0.15
103	300008	天海防务	1,225,900	9,672,351.00	0.15
104	600353	旭光电子	597,000	9,623,640.00	0.15
105	600988	赤峰黄金	306,400	9,571,936.00	0.15
106	688228	开普云	48,699	9,477,312.39	0.15
107	000831	中国稀土	200,100	9,292,644.00	0.14
108	605196	华通线缆	265,400	9,219,996.00	0.14
109	688280	精进电动	1,059,288	9,215,805.60	0.14
110	300683	海特生物	332,000	9,206,360.00	0.14
111	300602	飞荣达	276,700	9,175,372.00	0.14
112	000887	中鼎股份	395,000	9,167,950.00	0.14

113	600749	西藏旅游	530,700	9,064,356.00	0.14
114	000932	华菱钢铁	1,606,000	9,025,720.00	0.14
115	001287	中电港	394,100	8,930,306.00	0.14
116	603011	合锻智能	374,600	8,881,766.00	0.14
117	000683	博源化工	1,191,400	8,864,016.00	0.14
118	002657	中科金财	296,500	8,853,490.00	0.14
119	600330	天通股份	674,000	8,849,620.00	0.14
120	300726	宏达电子	172,200	8,766,702.00	0.14
121	300118	东方日升	594,700	8,718,302.00	0.13
122	300667	必创科技	488,700	8,640,216.00	0.13
123	002284	亚太股份	575,100	8,586,243.00	0.13
124	600973	宝胜股份	1,146,000	8,365,800.00	0.13
125	000933	神火股份	304,200	8,356,374.00	0.13
126	300777	中简科技	203,600	8,306,880.00	0.13
127	002595	豪迈科技	97,900	8,273,529.00	0.13
128	000629	钒钛股份	2,655,800	8,232,980.00	0.13
129	688772	珠海冠宇	381,244	8,208,183.32	0.13
130	300565	科信技术	650,600	8,204,066.00	0.13
131	002317	众生药业	432,100	8,201,258.00	0.13
132	300369	绿盟科技	1,092,580	8,172,498.40	0.13
133	301217	铜冠铜箔	232,752	7,978,738.56	0.12
134	002444	巨星科技	233,201	7,933,498.02	0.12
135	002204	大连重工	1,034,900	7,916,985.00	0.12
136	002093	国脉科技	679,000	7,808,500.00	0.12
137	002793	罗欣药业	1,625,200	7,800,960.00	0.12
138	000543	皖能电力	971,400	7,722,630.00	0.12
139	300316	晶盛机电	201,100	7,390,425.00	0.11
140	605358	立昂微	210,400	7,326,128.00	0.11
141	000301	东方盛虹	665,800	7,250,562.00	0.11
142	300503	昊志机电	113,000	7,200,360.00	0.11
143	002324	普利特	449,700	7,190,703.00	0.11
144	002294	信立泰	145,000	7,184,750.00	0.11
145	002544	普天科技	206,600	7,125,634.00	0.11
146	603876	鼎胜新材	474,600	7,123,746.00	0.11
147	002731	萃华珠宝	565,400	7,101,424.00	0.11
148	002756	永兴材料	130,700	7,090,475.00	0.11
149	002008	大族激光	169,900	6,998,181.00	0.11
150	300337	银邦股份	451,200	6,998,112.00	0.11
151	002182	宝武镁业	454,000	6,946,200.00	0.11
152	300129	泰胜风能	657,700	6,879,542.00	0.11
153	300990	同飞股份	76,000	6,851,400.00	0.11
154	002273	水晶光电	272,100	6,835,152.00	0.11
155	300378	鼎捷数智	150,100	6,793,526.00	0.10

156	600969	郴电国际	659,400	6,745,662.00	0.10
157	002745	木林森	683,100	6,537,267.00	0.10
158	002758	浙农股份	647,200	6,517,304.00	0.10
159	601686	友发集团	1,029,920	6,467,897.60	0.10
160	000422	湖北宜化	454,400	6,457,024.00	0.10
161	000792	盐湖股份	228,700	6,440,192.00	0.10
162	603906	龙蟠科技	320,900	6,421,209.00	0.10
163	600351	亚宝药业	969,218	6,290,224.82	0.10
164	002582	好想你	566,800	6,263,140.00	0.10
165	001205	盛航股份	360,000	6,156,000.00	0.10
166	600348	华阳股份	744,300	6,147,918.00	0.10
167	300434	金石亚药	592,500	6,090,900.00	0.09
168	002033	丽江股份	665,500	6,089,325.00	0.09
169	002518	科士达	124,300	6,031,036.00	0.09
170	002484	江海股份	202,300	6,008,310.00	0.09
171	600141	兴发集团	173,500	5,999,630.00	0.09
172	600998	九州通	1,170,672	5,993,840.64	0.09
173	603979	金诚信	78,400	5,970,160.00	0.09
174	601609	金田股份	552,200	5,963,760.00	0.09
175	601598	中国外运	979,600	5,936,376.00	0.09
176	300677	英科医疗	150,500	5,854,450.00	0.09
177	300693	盛弘股份	152,500	5,837,700.00	0.09
178	600168	武汉控股	1,145,040	5,828,253.60	0.09
179	002357	富临运业	541,600	5,805,952.00	0.09
180	002110	三钢闽光	1,317,200	5,782,508.00	0.09
181	300110	华仁药业	1,808,300	5,696,145.00	0.09
182	300538	同益股份	349,700	5,623,176.00	0.09
183	000601	韶能股份	1,187,100	5,579,370.00	0.09
184	603836	海程邦达	405,300	5,576,928.00	0.09
185	300365	恒华科技	877,500	5,545,800.00	0.09
186	000758	中色股份	829,600	5,508,544.00	0.09
187	000899	赣能股份	555,000	5,494,500.00	0.08
188	002174	游族网络	447,600	5,478,624.00	0.08
189	002863	今飞凯达	928,600	5,450,882.00	0.08
190	003030	祖名股份	267,800	5,406,882.00	0.08
191	600617	国新能源	1,715,200	5,385,728.00	0.08
192	603200	上海洗霸	75,100	5,342,614.00	0.08
193	000782	恒申新材	1,074,500	5,329,520.00	0.08
194	300334	津膜科技	764,800	5,323,008.00	0.08
195	301408	华人健康	285,600	5,300,736.00	0.08
196	002670	国盛证券	312,700	5,265,868.00	0.08
197	600222	太龙药业	798,100	5,251,498.00	0.08
198	688335	复洁科技	193,616	5,219,887.36	0.08

199	300162	雷曼光电	639,500	5,199,135.00	0.08
200	002391	长青股份	873,900	5,182,227.00	0.08
201	000612	焦作万方	468,100	5,158,462.00	0.08
202	300937	药易购	151,100	5,150,999.00	0.08
203	603026	石大胜华	68,600	5,131,966.00	0.08
204	000619	海螺新材	824,300	5,118,903.00	0.08
205	300707	威唐工业	311,000	5,115,950.00	0.08
206	002780	三夫户外	354,700	5,093,492.00	0.08
207	003011	海象新材	230,300	5,075,812.00	0.08
208	002614	奥佳华	693,800	5,071,678.00	0.08
209	000068	华控赛格	1,498,900	5,066,282.00	0.08
210	603338	浙江鼎力	89,200	5,052,288.00	0.08
211	002616	长青集团	919,671	5,021,403.66	0.08
212	002318	久立特材	173,400	5,019,930.00	0.08
213	600352	浙江龙盛	465,100	4,957,966.00	0.08
214	688388	嘉元科技	120,932	4,955,793.36	0.08
215	605589	圣泉集团	174,900	4,949,670.00	0.08
216	000893	亚钾国际	102,800	4,931,316.00	0.08
217	301286	侨源股份	115,300	4,876,037.00	0.08
218	600128	苏豪弘业	443,100	4,869,669.00	0.08
219	002746	仙坛股份	801,500	4,865,105.00	0.08
220	002250	联化科技	362,700	4,852,926.00	0.07
221	300681	英搏尔	193,400	4,846,604.00	0.07
222	300827	上能电气	141,540	4,843,498.80	0.07
223	300176	鸿特科技	721,100	4,809,737.00	0.07
224	002632	道明光学	385,000	4,793,250.00	0.07
225	603068	博通集成	127,500	4,783,800.00	0.07
226	605567	春雪食品	434,700	4,781,700.00	0.07
227	603063	禾望电气	144,400	4,775,308.00	0.07
228	300898	熊猫乳品	177,200	4,771,996.00	0.07
229	002414	高德红外	324,600	4,761,882.00	0.07
230	688025	杰普特	33,541	4,748,399.37	0.07
231	603810	丰山集团	296,300	4,731,911.00	0.07
232	000626	远大控股	594,700	4,715,971.00	0.07
233	603019	中科曙光	55,000	4,710,200.00	0.07
234	003003	天元股份	355,400	4,698,388.00	0.07
235	601168	西部矿业	169,700	4,690,508.00	0.07
236	603188	亚邦股份	1,020,900	4,685,931.00	0.07
237	688655	迅捷兴	273,141	4,678,905.33	0.07
238	601996	丰林集团	2,074,700	4,668,075.00	0.07
239	300868	杰美特	147,000	4,659,900.00	0.07
240	600785	新华百货	343,200	4,650,360.00	0.07
241	002858	力盛体育	308,900	4,633,500.00	0.07

242	002852	道道全	438,000	4,620,900.00	0.07
243	300787	海能实业	391,700	4,602,475.00	0.07
244	603967	中创物流	335,100	4,600,923.00	0.07
245	601126	四方股份	152,900	4,599,232.00	0.07
246	603051	鹿山新材	216,200	4,581,278.00	0.07
247	300113	顺网科技	225,900	4,572,216.00	0.07
248	300647	超频三	661,100	4,554,979.00	0.07
249	002120	韵达股份	674,500	4,546,130.00	0.07
250	605066	天正电气	622,700	4,545,710.00	0.07
251	301060	兰卫医学	490,500	4,537,125.00	0.07
252	000997	新大陆	160,000	4,531,200.00	0.07
253	003042	中农联合	281,700	4,524,102.00	0.07
254	002281	光迅科技	64,500	4,511,775.00	0.07
255	002382	蓝帆医疗	803,694	4,500,686.40	0.07
256	600249	两面针	777,200	4,468,900.00	0.07
257	300645	正元智慧	238,500	4,467,105.00	0.07
258	600761	安徽合力	212,600	4,441,214.00	0.07
259	603329	上海雅仕	403,300	4,436,300.00	0.07
260	000830	鲁西化工	267,700	4,435,789.00	0.07
261	600713	南京医药	806,000	4,400,760.00	0.07
262	000812	陕西金叶	919,800	4,396,644.00	0.07
263	002488	金固股份	499,700	4,392,363.00	0.07
264	300148	天舟文化	997,400	4,378,586.00	0.07
265	300195	长荣股份	544,400	4,360,644.00	0.07
266	000705	浙江震元	481,300	4,355,765.00	0.07
267	301349	信德新材	92,800	4,353,248.00	0.07
268	688186	广大特材	191,811	4,350,273.48	0.07
269	002064	华峰化学	394,500	4,339,500.00	0.07
270	603682	锦和商管	655,200	4,317,768.00	0.07
271	002156	通富微电	114,500	4,316,650.00	0.07
272	300956	英力股份	256,700	4,271,488.00	0.07
273	002968	新大正	351,200	4,270,592.00	0.07
274	600419	天润乳业	428,200	4,239,180.00	0.07
275	600686	金龙汽车	238,400	4,229,216.00	0.07
276	301248	杰创智能	131,300	4,225,234.00	0.07
277	002373	千方科技	357,200	4,204,244.00	0.06
278	600986	浙文互联	537,000	4,199,340.00	0.06
279	688556	高测股份	367,414	4,195,867.88	0.06
280	300883	龙利得	620,200	4,186,350.00	0.06
281	300891	惠云钛业	474,800	4,178,240.00	0.06
282	300596	利安隆	98,800	4,170,348.00	0.06
283	002828	贝肯能源	390,700	4,164,862.00	0.06
284	002799	环球印务	487,100	4,154,963.00	0.06

285	600982	宁波能源	957,000	4,153,380.00	0.06
286	300335	迪森股份	718,800	4,140,288.00	0.06
287	300007	汉威科技	77,200	4,137,920.00	0.06
288	300452	山河药辅	307,900	4,119,702.00	0.06
289	300283	温州宏丰	546,900	4,118,157.00	0.06
290	603168	莎普爱思	559,446	4,117,522.56	0.06
291	002181	粤传媒	476,400	4,106,568.00	0.06
292	000153	丰原药业	652,300	4,089,921.00	0.06
293	002527	新时达	230,200	4,083,748.00	0.06
294	000570	苏常柴 A	727,900	4,047,124.00	0.06
295	603326	我乐家居	452,800	4,029,920.00	0.06
296	600259	中稀有色	71,600	4,028,216.00	0.06
297	600262	北方股份	154,500	4,021,635.00	0.06
298	603313	梦百合	451,300	4,016,570.00	0.06
299	002256	兆新股份	1,150,800	4,016,292.00	0.06
300	002186	全聚德	340,100	4,006,378.00	0.06
301	600792	云煤能源	1,031,800	4,003,384.00	0.06
302	002897	意华股份	73,800	3,990,366.00	0.06
303	300083	创世纪	432,300	3,981,483.00	0.06
304	300584	海辰药业	79,200	3,977,424.00	0.06
305	002364	中恒电气	150,300	3,973,932.00	0.06
306	688689	银河微电	139,503	3,959,095.14	0.06
307	300497	富祥药业	260,400	3,934,644.00	0.06
308	300305	裕兴股份	659,200	3,922,240.00	0.06
309	300405	科隆股份	610,500	3,894,990.00	0.06
310	603700	宁水集团	285,000	3,873,150.00	0.06
311	002331	皖通科技	432,200	3,855,224.00	0.06
312	002367	康力电梯	477,500	3,848,650.00	0.06
313	000529	广弘控股	639,541	3,843,641.41	0.06
314	300616	尚品宅配	275,100	3,832,143.00	0.06
315	300811	铂科新材	53,700	3,829,347.00	0.06
316	002340	格林美	458,000	3,828,880.00	0.06
317	600833	第一医药	295,400	3,819,522.00	0.06
318	600470	六国化工	635,700	3,801,486.00	0.06
319	600768	宁波富邦	268,100	3,753,400.00	0.06
320	002541	鸿路钢构	226,600	3,725,304.00	0.06
321	300011	鼎汉技术	432,220	3,708,447.60	0.06
322	603637	镇海股份	340,900	3,705,583.00	0.06
323	600159	大龙地产	1,335,900	3,700,443.00	0.06
324	688558	国盛智科	127,573	3,690,686.89	0.06
325	603225	新凤鸣	189,200	3,681,832.00	0.06
326	301051	信濠光电	187,600	3,676,960.00	0.06
327	300635	中达安	229,100	3,672,473.00	0.06

328	002479	富春环保	749,220	3,671,178.00	0.06
329	000862	银星能源	628,100	3,668,104.00	0.06
330	300504	天邑股份	246,100	3,664,429.00	0.06
331	601608	中信重工	554,500	3,654,155.00	0.06
332	603717	天域生物	464,400	3,640,896.00	0.06
333	300771	智莱科技	234,600	3,636,300.00	0.06
334	000573	粤宏远 A	869,801	3,592,278.13	0.06
335	300845	捷安高科	317,382	3,576,895.14	0.06
336	605266	健之佳	186,100	3,576,842.00	0.06
337	600429	三元股份	689,300	3,570,574.00	0.06
338	002136	安纳达	294,100	3,570,374.00	0.06
339	600673	东阳光	158,700	3,559,641.00	0.06
340	600830	香溢融通	371,500	3,555,255.00	0.05
341	600935	华塑股份	1,449,600	3,551,520.00	0.05
342	002732	燕塘乳业	208,500	3,548,670.00	0.05
343	000973	佛塑科技	241,000	3,542,700.00	0.05
344	600628	新世界	450,600	3,541,716.00	0.05
345	001366	播恩集团	264,600	3,537,702.00	0.05
346	603486	科沃斯	43,800	3,533,784.00	0.05
347	600838	上海九百	326,100	3,528,402.00	0.05
348	002006	精工科技	152,300	3,527,268.00	0.05
349	300713	英可瑞	203,800	3,525,740.00	0.05
350	301123	奕东电子	47,900	3,523,524.00	0.05
351	002537	海联金汇	388,900	3,523,434.00	0.05
352	603856	东宏股份	282,500	3,522,775.00	0.05
353	301419	阿莱德	103,900	3,520,132.00	0.05
354	603285	键邦股份	144,500	3,520,020.00	0.05
355	603729	龙韵股份	218,700	3,518,883.00	0.05
356	601865	福莱特	224,500	3,517,915.00	0.05
357	601003	柳钢股份	698,600	3,513,958.00	0.05
358	605258	协和电子	112,000	3,502,240.00	0.05
359	002999	天禾股份	510,500	3,486,715.00	0.05
360	000717	中南股份	1,339,100	3,468,269.00	0.05
361	688602	康鹏科技	398,722	3,460,906.96	0.05
362	301539	宏鑫科技	164,500	3,438,050.00	0.05
363	300615	欣天科技	258,500	3,432,880.00	0.05
364	301218	华是科技	144,900	3,425,436.00	0.05
365	603183	建研院	793,800	3,421,278.00	0.05
366	600808	马钢股份	810,700	3,421,154.00	0.05
367	603808	歌力思	401,500	3,420,780.00	0.05
368	300025	华星创业	592,300	3,411,648.00	0.05
369	002653	海思科	66,400	3,407,648.00	0.05
370	002234	民和股份	395,100	3,405,762.00	0.05

371	688063	派能科技	59,893	3,403,120.26	0.05
372	688455	科捷智能	169,012	3,395,451.08	0.05
373	603766	隆鑫通用	210,600	3,392,766.00	0.05
374	600858	银座股份	540,300	3,376,875.00	0.05
375	603982	泉峰汽车	403,200	3,374,784.00	0.05
376	300239	东宝生物	573,500	3,360,710.00	0.05
377	301135	瑞德智能	119,400	3,355,140.00	0.05
378	600737	中粮糖业	194,700	3,350,787.00	0.05
379	000707	双环科技	550,100	3,328,105.00	0.05
380	002282	博深股份	451,000	3,314,850.00	0.05
381	600409	三友化工	535,400	3,314,126.00	0.05
382	300859	西域旅游	89,400	3,305,118.00	0.05
383	300381	溢多利	506,900	3,304,988.00	0.05
384	688312	燕麦科技	99,104	3,288,270.72	0.05
385	600476	湘邮科技	205,200	3,285,252.00	0.05
386	002982	湘佳股份	238,696	3,279,683.04	0.05
387	300550	和仁科技	226,000	3,279,260.00	0.05
388	600992	贵绳股份	241,300	3,274,441.00	0.05
389	300105	龙源技术	457,000	3,272,120.00	0.05
390	000713	国投丰乐	494,000	3,270,280.00	0.05
391	000415	渤海租赁	807,300	3,269,565.00	0.05
392	002998	优彩资源	433,000	3,269,150.00	0.05
393	002012	凯恩股份	505,500	3,260,475.00	0.05
394	000419	通程控股	505,000	3,226,950.00	0.05
395	688390	固德威	51,870	3,222,683.10	0.05
396	300289	利德曼	461,000	3,213,170.00	0.05
397	002820	桂发祥	266,600	3,212,530.00	0.05
398	300054	鼎龙股份	85,400	3,211,040.00	0.05
399	301159	三维天地	87,300	3,210,021.00	0.05
400	000070	特发信息	272,900	3,203,846.00	0.05
401	688216	气派科技	143,334	3,193,481.52	0.05
402	603712	七一二	153,500	3,188,195.00	0.05
403	300606	金太阳	134,500	3,162,095.00	0.05
404	000159	国际实业	545,800	3,154,724.00	0.05
405	301197	工大科雅	150,900	3,144,756.00	0.05
406	002641	公元股份	723,400	3,125,088.00	0.05
407	601636	旗滨集团	526,600	3,122,738.00	0.05
408	002286	保龄宝	348,300	3,113,802.00	0.05
409	001202	炬申股份	195,800	3,105,388.00	0.05
410	002442	龙星科技	498,100	3,093,201.00	0.05
411	002548	金新农	508,600	3,092,288.00	0.05
412	002454	松芝股份	354,500	3,087,695.00	0.05
413	001278	一彬科技	159,500	3,084,730.00	0.05

414	300609	汇纳科技	79,600	3,070,172.00	0.05
415	600261	阳光照明	911,000	3,070,070.00	0.05
416	001338	永顺泰	252,600	3,058,986.00	0.05
417	600805	悦达投资	560,100	3,041,343.00	0.05
418	300214	日科化学	454,500	3,036,060.00	0.05
419	603379	三美股份	50,000	3,036,000.00	0.05
420	603506	南都物业	232,200	3,032,532.00	0.05
421	002845	同兴达	215,500	3,032,085.00	0.05
422	600398	海澜之家	501,000	3,031,050.00	0.05
423	002498	汉缆股份	786,600	3,012,678.00	0.05
424	603289	泰瑞机器	297,300	3,008,676.00	0.05
425	300126	锐奇股份	350,800	3,002,848.00	0.05
426	605001	威奥股份	393,400	3,001,642.00	0.05
427	300243	瑞丰高材	287,200	2,995,496.00	0.05
428	300219	鸿利智汇	414,700	2,989,987.00	0.05
429	601007	金陵饭店	382,100	2,984,201.00	0.05
430	603937	丽岛新材	248,700	2,981,913.00	0.05
431	300747	锐科激光	109,900	2,970,597.00	0.05
432	002292	奥飞娱乐	335,100	2,965,635.00	0.05
433	600356	恒丰纸业	337,200	2,960,616.00	0.05
434	600569	安阳钢铁	1,313,100	2,954,475.00	0.05
435	688206	概伦电子	84,821	2,954,315.43	0.05
436	000561	烽火电子	241,700	2,953,574.00	0.05
437	301198	喜悦智行	235,100	2,952,856.00	0.05
438	603759	海天股份	280,100	2,952,254.00	0.05
439	301314	科瑞思	70,200	2,949,804.00	0.05
440	600097	开创国际	259,500	2,947,920.00	0.05
441	603970	中农立华	229,200	2,947,512.00	0.05
442	603881	数据港	96,720	2,943,189.60	0.05
443	688030	山石网科	161,853	2,940,869.01	0.05
444	000605	渤海股份	437,500	2,935,625.00	0.05
445	600506	统一股份	111,800	2,930,278.00	0.05
446	600331	宏达股份	229,000	2,928,910.00	0.05
447	300597	吉大通信	316,908	2,928,229.92	0.05
448	300552	万集科技	96,300	2,923,668.00	0.05
449	001201	东瑞股份	200,500	2,921,285.00	0.05
450	688357	建龙微纳	88,369	2,920,595.45	0.05
451	002333	罗普斯金	519,200	2,917,904.00	0.05
452	002887	绿茵生态	311,600	2,916,576.00	0.05
453	002873	新天药业	294,000	2,916,480.00	0.05
454	000702	正虹科技	433,900	2,898,452.00	0.04
455	603066	音飞储存	267,800	2,878,850.00	0.04
456	688531	日联科技	43,510	2,872,965.30	0.04

457	300112	万讯自控	333,300	2,869,713.00	0.04
458	603915	国茂股份	155,500	2,862,755.00	0.04
459	300812	易天股份	99,800	2,854,280.00	0.04
460	601999	出版传媒	415,400	2,853,798.00	0.04
461	603987	康德莱	331,500	2,850,900.00	0.04
462	600448	华纺股份	903,000	2,844,450.00	0.04
463	603065	宿迁联盛	341,600	2,838,696.00	0.04
464	688239	航宇科技	41,915	2,836,388.05	0.04
465	603156	养元饮品	98,600	2,834,750.00	0.04
466	688588	凌志软件	197,827	2,830,904.37	0.04
467	600333	长春燃气	511,500	2,828,595.00	0.04
468	600774	汉商集团	308,600	2,820,604.00	0.04
469	301128	强瑞技术	27,900	2,815,389.00	0.04
470	002960	青鸟消防	267,000	2,806,170.00	0.04
471	603916	苏博特	296,400	2,803,944.00	0.04
472	002841	视源股份	70,700	2,801,841.00	0.04
473	300929	华骐环保	258,200	2,775,650.00	0.04
474	688419	耐科装备	98,854	2,766,923.46	0.04
475	601058	赛轮轮胎	170,800	2,763,544.00	0.04
476	300187	永清环保	564,900	2,751,063.00	0.04
477	603214	爱婴室	159,700	2,740,452.00	0.04
478	600561	江西长运	422,600	2,738,448.00	0.04
479	301378	通达海	96,200	2,732,080.00	0.04
480	600057	厦门象屿	319,800	2,724,696.00	0.04
481	301063	海锅股份	111,300	2,716,833.00	0.04
482	301212	联盛化学	90,500	2,711,380.00	0.04
483	600282	南钢股份	515,200	2,709,952.00	0.04
484	002876	三利谱	113,100	2,707,614.00	0.04
485	603689	皖天然气	333,800	2,707,118.00	0.04
486	688638	誉辰智能	74,428	2,703,969.24	0.04
487	605169	洪通燃气	204,900	2,700,582.00	0.04
488	002223	鱼跃医疗	70,600	2,697,626.00	0.04
489	000065	北方国际	215,630	2,686,749.80	0.04
490	300694	蠡湖股份	222,100	2,682,968.00	0.04
491	605166	聚合顺	256,400	2,658,868.00	0.04
492	002551	尚荣医疗	727,800	2,656,470.00	0.04
493	603236	移远通信	27,800	2,652,398.00	0.04
494	301038	深水规院	112,200	2,631,090.00	0.04
495	605058	澳弘电子	86,100	2,627,772.00	0.04
496	001387	雪祺电气	189,800	2,623,036.00	0.04
497	001209	洪兴股份	125,600	2,620,016.00	0.04
498	002328	新朋股份	395,500	2,614,255.00	0.04
499	300800	力合科技	224,300	2,608,609.00	0.04

500	300254	仟源医药	257,600	2,606,912.00	0.04
501	000009	中国宝安	263,900	2,599,415.00	0.04
502	600498	烽火通信	80,900	2,595,272.00	0.04
503	300637	扬帆新材	222,910	2,592,443.30	0.04
504	002574	明牌珠宝	461,200	2,591,944.00	0.04
505	300224	正海磁材	166,900	2,580,274.00	0.04
506	600938	中国海油	85,400	2,577,372.00	0.04
507	000059	华锦股份	481,700	2,577,095.00	0.04
508	688517	金冠电气	165,165	2,574,922.35	0.04
509	002556	辉隆股份	425,100	2,567,604.00	0.04
510	301066	万事利	129,900	2,557,731.00	0.04
511	002967	广电计量	115,800	2,548,758.00	0.04
512	002671	龙泉股份	485,200	2,542,448.00	0.04
513	603327	福蓉科技	233,300	2,533,638.00	0.04
514	002054	德美化工	341,900	2,523,222.00	0.04
515	002659	凯文教育	430,000	2,519,800.00	0.04
516	688651	盛邦安全	57,044	2,511,076.88	0.04
517	603028	赛福天	267,415	2,492,307.80	0.04
518	003008	开普检测	115,400	2,486,870.00	0.04
519	002648	卫星化学	140,400	2,482,272.00	0.04
520	002696	百洋股份	350,600	2,478,742.00	0.04
521	603161	科华控股	180,200	2,474,146.00	0.04
522	002500	山西证券	411,110	2,462,548.90	0.04
523	002261	拓维信息	74,300	2,459,330.00	0.04
524	301158	德石股份	109,900	2,458,463.00	0.04
525	603282	亚光股份	123,900	2,458,176.00	0.04
526	603527	众源新材	221,500	2,456,435.00	0.04
527	002036	联创电子	222,800	2,455,256.00	0.04
528	002097	山河智能	197,800	2,454,698.00	0.04
529	002627	三峡旅游	330,200	2,450,084.00	0.04
530	600793	宜宾纸业	116,100	2,449,710.00	0.04
531	600379	宝光股份	209,600	2,443,936.00	0.04
532	300780	德恩精工	126,700	2,442,776.00	0.04
533	001311	多利科技	76,100	2,441,288.00	0.04
534	600258	首旅酒店	145,600	2,438,800.00	0.04
535	002661	克明食品	266,400	2,434,896.00	0.04
536	600719	大连热电	372,500	2,428,700.00	0.04
537	002151	北斗星通	53,456	2,428,506.08	0.04
538	600184	光电股份	126,900	2,418,714.00	0.04
539	600298	安琪酵母	55,200	2,414,448.00	0.04
540	603558	健盛集团	214,900	2,413,327.00	0.04
541	000970	中科三环	177,500	2,406,900.00	0.04
542	600588	用友网络	181,070	2,400,988.20	0.04

543	603076	乐惠国际	102,400	2,400,256.00	0.04
544	002060	广东建工	662,800	2,386,080.00	0.04
545	300928	华安鑫创	76,500	2,382,975.00	0.04
546	603995	甬金股份	131,800	2,382,944.00	0.04
547	601065	江盐集团	287,100	2,382,930.00	0.04
548	301163	宏德股份	88,900	2,381,631.00	0.04
549	600195	中牧股份	302,600	2,381,462.00	0.04
550	002533	金杯电工	190,800	2,381,184.00	0.04
551	300876	蒙泰高新	67,500	2,380,725.00	0.04
552	601918	新集能源	360,100	2,380,261.00	0.04
553	600531	豫光金铅	202,400	2,378,200.00	0.04
554	300132	青松股份	272,900	2,376,959.00	0.04
555	301222	浙江恒威	83,300	2,375,716.00	0.04
556	600778	友好集团	355,800	2,373,186.00	0.04
557	600714	金瑞矿业	193,400	2,371,084.00	0.04
558	300970	华绿生物	115,400	2,366,854.00	0.04
559	601366	利群股份	484,851	2,366,072.88	0.04
560	603136	天目湖	200,800	2,365,424.00	0.04
561	600616	金枫酒业	440,900	2,363,224.00	0.04
562	301487	盟固利	107,700	2,361,861.00	0.04
563	603681	永冠新材	124,400	2,361,112.00	0.04
564	300425	中建环能	476,011	2,356,254.45	0.04
565	002330	得利斯	486,800	2,356,112.00	0.04
566	002706	良信股份	218,500	2,355,430.00	0.04
567	002972	科安达	196,900	2,352,955.00	0.04
568	301512	智信精密	53,700	2,348,838.00	0.04
569	301216	万凯新材	139,300	2,348,598.00	0.04
570	300958	建工修复	188,400	2,338,044.00	0.04
571	603339	四方科技	181,900	2,333,777.00	0.04
572	000919	金陵药业	293,400	2,332,530.00	0.04
573	603231	索宝蛋白	127,000	2,326,640.00	0.04
574	600854	春兰股份	466,100	2,325,839.00	0.04
575	600098	广州发展	355,500	2,324,970.00	0.04
576	000720	新能泰山	710,100	2,322,027.00	0.04
577	300371	汇中股份	184,700	2,321,679.00	0.04
578	300838	浙江力诺	152,100	2,319,525.00	0.04
579	001218	丽臣实业	101,800	2,319,004.00	0.04
580	603777	来伊份	168,800	2,317,624.00	0.04
581	002121	科陆电子	300,600	2,314,620.00	0.04
582	601616	广电电气	598,100	2,308,666.00	0.04
583	301167	建研设计	142,000	2,307,500.00	0.04
584	600386	北巴传媒	525,000	2,304,750.00	0.04
585	603968	醋化股份	206,200	2,303,254.00	0.04

586	002879	长缆科技	124,000	2,302,680.00	0.04
587	000881	中广核技	254,300	2,301,415.00	0.04
588	605089	味知香	90,300	2,299,038.00	0.04
589	300172	中电环保	421,800	2,298,810.00	0.04
590	600578	京能电力	449,700	2,293,470.00	0.04
591	601368	绿城水务	462,300	2,293,008.00	0.04
592	600063	皖维高新	388,400	2,287,676.00	0.04
593	000586	汇源通信	168,200	2,275,746.00	0.04
594	600396	华电辽能	796,500	2,270,025.00	0.04
595	605222	起帆电缆	123,400	2,269,326.00	0.04
596	002663	普邦股份	1,200,400	2,268,756.00	0.04
597	002203	海亮股份	179,200	2,268,672.00	0.04
598	300520	科大国创	65,000	2,267,850.00	0.04
599	002022	科华生物	381,400	2,265,516.00	0.04
600	301320	豪江智能	133,200	2,260,404.00	0.03
601	301389	隆扬电子	41,400	2,259,612.00	0.03
602	002035	华帝股份	364,200	2,258,040.00	0.03
603	003037	三和管桩	278,100	2,252,610.00	0.03
604	600371	万向德农	257,900	2,248,888.00	0.03
605	603070	万控智造	172,700	2,238,192.00	0.03
606	000421	南京公用	323,800	2,237,458.00	0.03
607	300675	建科院	143,100	2,235,222.00	0.03
608	688199	久日新材	94,719	2,232,526.83	0.03
609	000822	山东海化	423,200	2,221,800.00	0.03
610	601991	大唐发电	630,600	2,200,794.00	0.03
611	300583	赛托生物	160,700	2,199,983.00	0.03
612	000911	广农糖业	297,800	2,176,918.00	0.03
613	000967	盈峰环境	296,200	2,174,108.00	0.03
614	603059	倍加洁	72,100	2,168,768.00	0.03
615	300966	共同药业	110,000	2,165,900.00	0.03
616	002722	物产金轮	144,000	2,161,440.00	0.03
617	300461	田中精机	113,000	2,156,040.00	0.03
618	002624	完美世界	131,200	2,150,368.00	0.03
619	688536	思瑞浦	13,431	2,147,348.28	0.03
620	300872	天阳科技	104,200	2,142,352.00	0.03
621	301499	维科精密	72,500	2,133,675.00	0.03
622	603385	惠达卫浴	310,900	2,126,556.00	0.03
623	600598	北大荒	142,000	2,122,900.00	0.03
624	002443	金洲管道	260,000	2,121,600.00	0.03
625	688045	必易微	54,754	2,118,432.26	0.03
626	002778	中晟高科	100,000	2,114,000.00	0.03
627	300428	立中集团	90,400	2,110,840.00	0.03
628	603997	继峰股份	150,900	2,097,510.00	0.03

629	002404	嘉欣丝绸	298,900	2,095,289.00	0.03
630	002172	澳洋健康	526,800	2,091,396.00	0.03
631	603609	禾丰股份	294,900	2,090,841.00	0.03
632	300919	中伟新材	45,100	2,089,483.00	0.03
633	688355	明志科技	117,143	2,085,145.40	0.03
634	300150	世纪瑞尔	393,300	2,080,557.00	0.03
635	301313	凡拓数创	78,400	2,078,384.00	0.03
636	000850	华茂股份	378,800	2,072,036.00	0.03
637	300639	凯普生物	381,807	2,054,121.66	0.03
638	600120	浙江东方	330,900	2,041,653.00	0.03
639	000810	创维数字	172,400	2,030,872.00	0.03
640	603029	天鹅股份	111,200	2,028,288.00	0.03
641	603331	百达精工	141,300	2,013,525.00	0.03
642	301361	众智科技	61,700	2,010,803.00	0.03
643	000151	中成股份	169,100	2,008,908.00	0.03
644	688056	莱伯泰科	59,727	2,007,424.47	0.03
645	300106	西部牧业	186,700	2,007,025.00	0.03
646	300387	富邦科技	235,400	2,003,254.00	0.03
647	603079	圣达生物	112,900	2,000,588.00	0.03
648	301045	天禄科技	75,300	1,997,709.00	0.03
649	000548	湖南投资	365,900	1,990,496.00	0.03
650	600230	沧州大化	130,400	1,989,904.00	0.03
651	600497	驰宏锌锗	267,500	1,955,425.00	0.03
652	300772	运达股份	102,500	1,953,650.00	0.03
653	603566	普莱柯	157,000	1,951,510.00	0.03
654	603577	汇金通	184,500	1,940,940.00	0.03
655	000636	风华高科	119,100	1,938,948.00	0.03
656	001319	铭科精技	70,500	1,936,635.00	0.03
657	688667	菱电电控	27,498	1,936,409.16	0.03
658	000050	深天马 A	212,900	1,922,487.00	0.03
659	600784	鲁银投资	275,200	1,920,896.00	0.03
660	001260	坤泰股份	95,000	1,911,400.00	0.03
661	001266	宏英智能	48,500	1,909,445.00	0.03
662	600208	衢州发展	493,000	1,907,910.00	0.03
663	688150	莱特光电	70,441	1,904,020.23	0.03
664	001219	青岛食品	133,500	1,902,375.00	0.03
665	300457	赢合科技	68,300	1,902,155.00	0.03
666	300789	唐源电气	82,300	1,892,900.00	0.03
667	301131	聚赛龙	39,200	1,892,184.00	0.03
668	002969	嘉美包装	149,000	1,886,340.00	0.03
669	002144	宏达高科	148,500	1,884,465.00	0.03
670	002774	快意电梯	202,000	1,874,560.00	0.03
671	688153	唯捷创芯	49,678	1,869,879.92	0.03

672	002757	南兴股份	95,800	1,865,226.00	0.03
673	688778	厦钨新能	24,104	1,864,926.48	0.03
674	300837	浙矿股份	54,700	1,860,894.00	0.03
675	002664	信质集团	77,600	1,859,296.00	0.03
676	603725	天安新材	200,800	1,857,400.00	0.03
677	300531	优博讯	102,700	1,852,708.00	0.03
678	603135	中重科技	201,080	1,851,946.80	0.03
679	603886	元祖股份	132,500	1,851,025.00	0.03
680	300644	南京聚隆	50,000	1,845,500.00	0.03
681	301049	超越科技	85,900	1,845,132.00	0.03
682	301170	锡南科技	65,700	1,836,315.00	0.03
683	603110	东方材料	114,300	1,835,658.00	0.03
684	603206	嘉环科技	105,900	1,831,011.00	0.03
685	600967	内蒙一机	108,800	1,827,840.00	0.03
686	600885	宏发股份	60,100	1,827,040.00	0.03
687	603073	彩蝶实业	96,700	1,816,993.00	0.03
688	300691	联合光电	105,200	1,816,804.00	0.03
689	300692	中赋科技	216,000	1,814,400.00	0.03
690	300923	研奥股份	71,000	1,812,630.00	0.03
691	002986	宇新股份	168,400	1,811,984.00	0.03
692	002126	银轮股份	47,900	1,810,620.00	0.03
693	301305	朗坤科技	80,500	1,808,835.00	0.03
694	688092	爱科科技	71,847	1,806,233.58	0.03
695	001217	华尔泰	129,900	1,805,610.00	0.03
696	600235	民丰特纸	265,400	1,804,720.00	0.03
697	600637	东方明珠	183,100	1,803,535.00	0.03
698	000993	闽东电力	150,400	1,801,792.00	0.03
699	300995	奇德新材	43,600	1,801,116.00	0.03
700	688718	唯赛勃	137,682	1,800,880.56	0.03
701	301266	宇邦新材	49,500	1,799,325.00	0.03
702	002905	金逸影视	159,200	1,798,960.00	0.03
703	002726	龙大美食	437,700	1,798,947.00	0.03
704	301027	华蓝集团	97,700	1,798,657.00	0.03
705	300375	鹏翎股份	341,900	1,798,394.00	0.03
706	002449	国星光电	212,500	1,797,750.00	0.03
707	002734	利民股份	112,700	1,796,438.00	0.03
708	002044	美年健康	340,200	1,796,256.00	0.03
709	603519	立霸股份	149,100	1,793,673.00	0.03
710	605151	西上海	94,900	1,792,661.00	0.03
711	301503	智迪科技	49,700	1,792,182.00	0.03
712	002957	科瑞技术	82,700	1,790,455.00	0.03
713	000880	潍柴重机	65,500	1,789,460.00	0.03
714	002921	联诚精密	104,900	1,785,398.00	0.03

715	601010	文峰股份	653,900	1,785,147.00	0.03
716	300853	申昊科技	86,100	1,783,992.00	0.03
716	301231	荣信文化	57,400	1,783,992.00	0.03
717	300240	飞力达	236,500	1,783,210.00	0.03
718	300701	森霸传感	137,100	1,782,300.00	0.03
719	688170	德龙激光	56,583	1,780,101.18	0.03
720	605268	王力安防	166,800	1,779,756.00	0.03
721	603105	芯能科技	193,500	1,778,265.00	0.03
722	603096	新经典	102,000	1,776,840.00	0.03
723	300512	中亚股份	186,550	1,775,956.00	0.03
724	301555	惠柏新材	53,120	1,775,801.60	0.03
725	600776	东方通信	107,600	1,775,400.00	0.03
726	300127	银河磁体	58,500	1,774,305.00	0.03
727	002909	集泰股份	260,200	1,771,962.00	0.03
728	603221	爱丽家居	135,200	1,771,120.00	0.03
729	603208	江山欧派	121,700	1,770,735.00	0.03
730	002350	北京科锐	217,400	1,769,636.00	0.03
731	002824	和胜股份	91,200	1,769,280.00	0.03
732	688633	星球石墨	74,709	1,769,109.12	0.03
733	002760	凤形股份	81,400	1,767,194.00	0.03
734	002243	力合科创	177,500	1,766,125.00	0.03
735	300656	民德电子	80,200	1,766,004.00	0.03
736	301388	欣灵电气	58,100	1,765,078.00	0.03
737	003021	兆威机电	14,200	1,763,356.00	0.03
738	600488	津药药业	431,100	1,763,199.00	0.03
739	603048	浙江黎明	83,400	1,763,076.00	0.03
740	688251	井松智能	59,948	1,762,471.20	0.03
741	300556	丝路视觉	92,700	1,760,373.00	0.03
742	603659	璞泰来	64,300	1,757,962.00	0.03
743	002767	先锋电子	76,700	1,757,197.00	0.03
744	301067	显盈科技	53,619	1,756,558.44	0.03
745	600354	敦煌种业	271,200	1,754,664.00	0.03
746	002105	信隆健康	239,500	1,753,140.00	0.03
747	301115	联检科技	110,800	1,751,748.00	0.03
748	301037	保立佳	121,600	1,751,040.00	0.03
749	002116	中国海诚	170,300	1,750,684.00	0.03
750	688448	磁谷科技	36,093	1,749,427.71	0.03
751	601179	中国西电	192,200	1,749,020.00	0.03
752	603596	伯特利	34,100	1,748,307.00	0.03
753	301106	骏成科技	58,500	1,741,545.00	0.03
754	301335	天元宠物	60,300	1,739,052.00	0.03
755	301118	恒光股份	70,200	1,738,152.00	0.03
756	000565	渝三峡 A	238,000	1,737,400.00	0.03

757	002741	光华科技	86,600	1,737,196.00	0.03
758	688557	兰剑智能	47,576	1,733,193.68	0.03
759	301519	舜禹股份	129,100	1,732,522.00	0.03
760	300977	深圳瑞捷	100,750	1,731,892.50	0.03
761	688350	富淼科技	67,243	1,730,162.39	0.03
762	301032	新柴股份	143,300	1,723,899.00	0.03
763	605162	新中港	201,700	1,722,518.00	0.03
764	301089	拓新药业	61,400	1,719,200.00	0.03
765	301238	瑞泰新材	84,200	1,717,680.00	0.03
766	003027	同兴科技	76,900	1,714,870.00	0.03
767	600284	浦东建设	204,100	1,714,440.00	0.03
768	002866	传艺科技	95,100	1,712,751.00	0.03
769	688593	新相微	84,828	1,711,829.04	0.03
770	603948	建业股份	62,500	1,706,250.00	0.03
771	300319	麦捷科技	145,100	1,696,219.00	0.03
772	300985	致远新能	92,400	1,695,540.00	0.03
773	300246	宝莱特	209,000	1,692,900.00	0.03
774	300562	乐心医疗	126,800	1,690,244.00	0.03
775	688600	皖仪科技	66,982	1,677,899.10	0.03
776	603900	莱绅通灵	197,800	1,673,388.00	0.03
777	600865	百大集团	102,000	1,672,800.00	0.03
778	603267	鸿远电子	30,700	1,671,001.00	0.03
779	603520	司太立	177,500	1,668,500.00	0.03
780	688127	蓝特光学	43,330	1,667,771.70	0.03
781	600712	南宁百货	244,400	1,666,808.00	0.03
782	000856	冀东装备	162,200	1,664,172.00	0.03
783	002923	润都股份	136,800	1,662,120.00	0.03
784	301258	富士莱	50,900	1,654,250.00	0.03
785	300409	道氏技术	73,500	1,653,015.00	0.03
786	603172	万丰股份	92,700	1,650,060.00	0.03
787	301502	华阳智能	36,738	1,641,453.84	0.03
788	603895	天永智能	56,100	1,635,876.00	0.03
789	688118	普元信息	64,025	1,633,918.00	0.03
790	605388	均瑶健康	219,100	1,630,104.00	0.03
791	002694	顾地科技	431,800	1,623,568.00	0.03
792	002358	森源电气	298,900	1,620,038.00	0.03
793	002815	崇达技术	118,000	1,611,880.00	0.02
794	600573	惠泉啤酒	134,800	1,608,164.00	0.02
795	603839	安正时尚	196,500	1,605,405.00	0.02
796	000400	许继电气	62,300	1,601,733.00	0.02
797	603818	曲美家居	441,700	1,594,537.00	0.02
798	603496	恒为科技	58,400	1,593,152.00	0.02
799	300833	浩洋股份	39,100	1,590,588.00	0.02

800	605588	冠石科技	31,500	1,590,435.00	0.02
801	300519	新光药业	106,100	1,580,890.00	0.02
802	603606	东方电缆	26,200	1,565,450.00	0.02
803	000778	新兴铸管	374,100	1,563,738.00	0.02
804	300002	神州泰岳	135,600	1,562,112.00	0.02
805	300154	瑞凌股份	158,300	1,559,255.00	0.02
806	603165	荣晟环保	123,000	1,555,950.00	0.02
807	600479	千金药业	152,700	1,551,432.00	0.02
808	301577	美信科技	27,200	1,535,712.00	0.02
809	002753	永东股份	214,300	1,527,959.00	0.02
810	601208	东材科技	56,300	1,525,167.00	0.02
811	300618	寒锐钴业	33,700	1,523,577.00	0.02
812	601156	东航物流	82,700	1,522,507.00	0.02
813	301185	鸥玛软件	79,100	1,510,810.00	0.02
814	603806	福斯特	108,200	1,510,472.00	0.02
815	300012	华测检测	111,100	1,505,405.00	0.02
816	688528	秦川物联	139,400	1,501,338.00	0.02
817	002239	奥特佳	503,300	1,499,834.00	0.02
818	600583	海油工程	272,600	1,496,574.00	0.02
819	603860	中公高科	49,600	1,496,432.00	0.02
820	603976	正川股份	77,400	1,496,142.00	0.02
821	600801	华新建材	60,900	1,494,486.00	0.02
822	300927	江天化学	63,700	1,484,847.00	0.02
823	300988	津荣天宇	64,700	1,471,925.00	0.02
824	000750	国海证券	344,600	1,461,104.00	0.02
825	002817	黄山胶囊	191,800	1,457,680.00	0.02
826	688737	中自科技	64,665	1,451,082.60	0.02
827	603858	步长制药	92,200	1,442,008.00	0.02
828	603811	诚意药业	136,900	1,437,450.00	0.02
829	300664	鹏鹞环保	264,700	1,418,792.00	0.02
830	600137	浪莎股份	73,600	1,415,328.00	0.02
831	688398	赛特新材	83,197	1,414,349.00	0.02
832	688218	江苏北人	61,884	1,412,192.88	0.02
833	003017	大洋生物	47,200	1,409,392.00	0.02
834	301097	天益医疗	27,300	1,409,226.00	0.02
835	300098	高新兴	229,400	1,399,340.00	0.02
836	603045	福达合金	70,900	1,393,185.00	0.02
837	000049	德赛电池	51,600	1,387,008.00	0.02
838	688395	正弦电气	56,834	1,382,202.88	0.02
839	600361	创新新材	324,100	1,374,184.00	0.02
840	002928	华夏航空	123,900	1,369,095.00	0.02
841	001231	农心科技	54,700	1,364,218.00	0.02
842	300220	金运激光	94,300	1,353,205.00	0.02

843	603568	伟明环保	53,000	1,345,140.00	0.02
844	603328	依顿电子	122,700	1,344,792.00	0.02
845	000576	甘化科工	125,900	1,325,727.00	0.02
846	000709	河钢股份	569,600	1,315,776.00	0.02
847	301059	金三江	104,290	1,314,054.00	0.02
848	002908	德生科技	124,600	1,312,038.00	0.02
849	603787	新日股份	93,000	1,307,580.00	0.02
850	002687	乔治白	270,800	1,305,256.00	0.02
851	300279	和晶科技	180,700	1,304,654.00	0.02
852	002492	恒基达鑫	148,500	1,297,890.00	0.02
853	300535	达威股份	72,600	1,296,636.00	0.02
854	002809	红墙股份	121,200	1,295,628.00	0.02
855	300234	开尔新材	235,300	1,294,150.00	0.02
856	300790	宇瞳光学	43,200	1,292,112.00	0.02
857	603768	常青股份	111,300	1,291,080.00	0.02
858	600268	国电南自	122,800	1,286,944.00	0.02
859	300514	友讯达	97,300	1,285,333.00	0.02
860	000039	中集集团	126,500	1,276,385.00	0.02
861	000990	诚志股份	161,100	1,275,912.00	0.02
862	603801	志邦家居	139,300	1,274,595.00	0.02
863	600863	内蒙华电	284,100	1,272,768.00	0.02
864	300610	晨化股份	109,600	1,272,456.00	0.02
865	000757	浩物股份	260,300	1,267,661.00	0.02
866	688065	凯赛生物	25,437	1,266,762.60	0.02
867	301429	森泰股份	66,300	1,259,700.00	0.02
868	688310	迈得医疗	81,847	1,254,714.51	0.02
869	603080	新疆火炬	53,000	1,251,860.00	0.02
870	600540	新赛股份	273,900	1,251,723.00	0.02
871	688328	深科达	42,883	1,251,325.94	0.02
872	300218	安利股份	76,800	1,248,000.00	0.02
873	603685	晨丰科技	64,000	1,247,360.00	0.02
874	688401	路维光电	25,515	1,245,387.15	0.02
875	600539	狮头股份	122,300	1,245,014.00	0.02
876	300466	赛摩智能	123,300	1,239,165.00	0.02
877	000423	东阿阿胶	25,200	1,236,816.00	0.02
878	300992	泰福泵业	45,700	1,233,900.00	0.02
879	002576	通达动力	70,900	1,233,660.00	0.02
880	301283	聚胶股份	25,800	1,232,724.00	0.02
881	600328	中盐化工	149,600	1,232,704.00	0.02
882	603788	宁波高发	75,400	1,232,036.00	0.02
883	002942	新农股份	64,100	1,232,002.00	0.02
884	002826	易明医药	67,000	1,231,460.00	0.02
885	300749	顶固集创	102,000	1,231,140.00	0.02

886	002881	美格智能	27,600	1,229,856.00	0.02
887	002933	新兴装备	33,900	1,227,180.00	0.02
888	001324	长青科技	68,000	1,226,720.00	0.02
889	688425	铁建重工	241,877	1,226,316.39	0.02
890	002995	天地在线	74,200	1,225,784.00	0.02
891	002023	海特高新	90,400	1,224,016.00	0.02
892	001316	润贝航科	30,980	1,223,090.40	0.02
893	002540	亚太科技	172,700	1,222,716.00	0.02
894	603639	海利尔	96,200	1,221,740.00	0.02
895	600319	亚星化学	131,500	1,220,320.00	0.02
896	000030	富奥股份	212,000	1,216,880.00	0.02
897	300922	天秦装备	53,200	1,216,684.00	0.02
898	603306	华懋科技	19,300	1,216,093.00	0.02
899	000554	泰山石油	187,400	1,214,352.00	0.02
900	600060	海信视像	50,000	1,214,000.00	0.02
901	001358	兴欣新材	47,000	1,213,070.00	0.02
902	688597	煜邦电力	147,746	1,212,994.66	0.02
903	600579	中化装备	146,000	1,211,800.00	0.02
904	603167	渤海轮渡	128,300	1,209,869.00	0.02
905	603899	晨光股份	44,700	1,209,582.00	0.02
906	002566	益盛药业	158,400	1,208,592.00	0.02
907	300665	飞鹿股份	123,600	1,206,336.00	0.02
908	000607	华媒控股	290,600	1,205,990.00	0.02
909	600897	厦门空港	70,100	1,205,720.00	0.02
910	600250	南京商旅	104,700	1,205,097.00	0.02
911	603602	纵横通信	82,700	1,204,112.00	0.02
912	603727	博迈科	86,100	1,203,678.00	0.02
913	301151	冠龙节能	64,000	1,203,200.00	0.02
914	002224	三力士	273,900	1,202,421.00	0.02
915	600148	长春一东	61,400	1,201,598.00	0.02
916	002715	登云股份	69,200	1,201,312.00	0.02
917	002247	聚力文化	427,400	1,200,994.00	0.02
918	300135	宝利国际	304,000	1,200,800.00	0.02
919	688285	高铁电气	138,219	1,199,740.92	0.02
920	301072	中捷精工	53,200	1,198,064.00	0.02
921	605003	众望布艺	33,700	1,198,035.00	0.02
922	688627	精智达	5,357	1,197,771.63	0.02
923	301156	美农生物	68,400	1,197,684.00	0.02
924	603368	柳药集团	67,200	1,197,504.00	0.02
925	300854	中兰环保	71,100	1,197,324.00	0.02
926	603112	华翔股份	68,900	1,196,793.00	0.02
927	601700	风范股份	211,400	1,196,524.00	0.02
928	000902	新洋丰	76,600	1,196,492.00	0.02

929	688618	三旺通信	44,870	1,196,234.20	0.02
930	301509	金凯生科	35,400	1,195,812.00	0.02
931	300855	图南股份	37,000	1,195,100.00	0.02
932	603180	金牌家居	58,600	1,194,854.00	0.02
933	300101	振芯科技	42,000	1,194,060.00	0.02
934	000923	河钢资源	56,400	1,193,988.00	0.02
935	601798	蓝科高新	134,600	1,193,902.00	0.02
936	002692	远程股份	234,800	1,192,784.00	0.02
937	001896	豫能控股	229,300	1,192,360.00	0.02
938	300278	华昌达	195,300	1,191,330.00	0.02
939	603182	嘉华股份	75,300	1,191,246.00	0.02
940	603396	金辰股份	35,500	1,191,025.00	0.02
941	301125	腾亚精工	64,800	1,191,024.00	0.02
942	600281	华阳新材	201,800	1,190,620.00	0.02
943	002445	中南文化	457,900	1,190,540.00	0.02
944	002188	中天服务	195,800	1,190,464.00	0.02
945	688026	洁特生物	73,817	1,189,191.87	0.02
946	002910	庄园牧场	107,000	1,188,770.00	0.02
947	600463	空港股份	105,000	1,188,600.00	0.02
948	000420	吉林化纤	262,300	1,188,219.00	0.02
949	301219	腾远钴业	17,400	1,188,072.00	0.02
950	002840	华统股份	123,500	1,188,070.00	0.02
951	600455	博通股份	45,700	1,186,829.00	0.02
952	301278	快可电子	35,500	1,186,765.00	0.02
953	002644	佛慈制药	137,300	1,186,272.00	0.02
954	300557	理工光科	33,600	1,185,744.00	0.02
955	000985	大庆华科	62,000	1,184,820.00	0.02
956	002869	金溢科技	50,900	1,183,934.00	0.02
957	300332	天壕能源	226,700	1,183,374.00	0.02
958	603755	日辰股份	32,200	1,180,774.00	0.02
959	600728	佳都科技	176,700	1,180,356.00	0.02
960	688420	美腾科技	49,430	1,179,894.10	0.02
961	300435	中泰股份	53,100	1,179,882.00	0.02
962	300410	正业科技	144,200	1,179,556.00	0.02
963	300823	建科智能	75,500	1,179,310.00	0.02
964	600444	国机通用	64,300	1,178,619.00	0.02
965	002606	大连电瓷	134,500	1,175,530.00	0.02
966	002900	哈三联	94,300	1,174,978.00	0.02
967	600618	氯碱化工	98,900	1,174,932.00	0.02
968	603237	五芳斋	70,400	1,174,272.00	0.02
969	300870	欧陆通	5,300	1,171,300.00	0.02
970	000789	万年青	223,800	1,170,474.00	0.02
971	301186	超达装备	24,100	1,170,296.00	0.02

972	000006	深振业 A	117,500	1,169,125.00	0.02
973	300398	飞凯材料	52,100	1,167,561.00	0.02
974	300003	乐普医疗	73,700	1,165,197.00	0.02
975	002516	旷达科技	176,800	1,165,112.00	0.02
976	002511	中顺洁柔	136,100	1,165,016.00	0.02
977	301386	未来电器	49,500	1,163,250.00	0.02
978	301290	东星医疗	45,900	1,159,893.00	0.02
979	601098	中南传媒	103,000	1,159,780.00	0.02
980	300141	和顺电气	92,200	1,158,954.00	0.02
981	600529	山东药玻	58,100	1,157,933.00	0.02
982	300687	赛意信息	50,400	1,157,688.00	0.02
983	301363	美好医疗	48,100	1,156,805.00	0.02
984	301176	逸豪新材	45,900	1,155,303.00	0.02
985	002842	翔鹭钨业	79,800	1,153,908.00	0.02
986	300916	朗特智能	35,200	1,153,856.00	0.02
987	002987	京北方	53,500	1,151,855.00	0.02
988	601500	通用股份	238,900	1,151,498.00	0.02
989	003022	联泓新科	58,100	1,150,961.00	0.02
990	000681	视觉中国	48,300	1,150,023.00	0.02
991	688345	博力威	36,785	1,147,692.00	0.02
992	301510	固高科技	30,600	1,145,970.00	0.02
993	601399	国机重装	239,500	1,144,810.00	0.02
994	688178	万德斯	47,627	1,144,476.81	0.02
995	603307	扬州金泉	29,100	1,143,921.00	0.02
996	600027	华电国际	230,300	1,142,288.00	0.02
997	600590	泰豪科技	120,900	1,137,669.00	0.02
998	002262	恩华药业	47,100	1,136,523.00	0.02
999	002052	同洲电子	88,800	1,132,200.00	0.02
1,000	688613	奥精医疗	55,637	1,129,987.47	0.02
1,001	000429	粤高速 A	95,800	1,128,524.00	0.02
1,002	688519	南亚新材	13,945	1,127,592.70	0.02
1,003	601975	招商南油	372,500	1,124,950.00	0.02
1,004	600697	欧亚集团	85,200	1,123,788.00	0.02
1,005	000403	派林生物	82,000	1,122,580.00	0.02
1,006	603117	万林物流	237,600	1,121,472.00	0.02
1,007	000783	长江证券	137,400	1,119,810.00	0.02
1,008	603116	红蜻蜓	181,800	1,114,434.00	0.02
1,009	300746	汉嘉数智	87,900	1,113,693.00	0.02
1,010	688115	思林杰	16,888	1,107,515.04	0.02
1,011	603367	辰欣药业	63,800	1,105,016.00	0.02
1,012	603102	百合股份	25,700	1,104,329.00	0.02
1,013	002233	塔牌集团	121,000	1,090,210.00	0.02
1,014	301041	金百泽	39,900	1,085,280.00	0.02

1, 015	300382	斯莱克	69, 200	1, 076, 752. 00	0. 02
1, 016	605189	富春染织	68, 700	1, 076, 529. 00	0. 02
1, 017	002666	德联集团	194, 800	1, 073, 348. 00	0. 02
1, 018	002062	宏润建设	113, 900	1, 053, 575. 00	0. 02
1, 019	600888	新疆众和	128, 200	1, 049, 958. 00	0. 02
1, 020	002430	杭氧股份	35, 000	1, 045, 450. 00	0. 02
1, 021	601518	吉林高速	369, 500	1, 041, 990. 00	0. 02
1, 022	603917	合力科技	70, 300	1, 039, 737. 00	0. 02
1, 023	002747	埃斯顿	43, 600	1, 033, 320. 00	0. 02
1, 024	600981	苏豪汇鸿	324, 500	1, 018, 930. 00	0. 02
1, 025	002701	奥瑞金	171, 200	1, 018, 640. 00	0. 02
1, 026	301296	新巨丰	118, 900	1, 013, 028. 00	0. 02
1, 027	301235	华康洁淨	27, 400	1, 010, 238. 00	0. 02
1, 028	001255	博菲电气	31, 300	1, 002, 539. 00	0. 02
1, 029	603739	蔚蓝生物	70, 600	998, 990. 00	0. 02
1, 030	002021	中捷资源	404, 200	998, 374. 00	0. 02
1, 031	002167	东方锆业	80, 200	990, 470. 00	0. 02
1, 032	600977	中国电影	62, 700	985, 644. 00	0. 02
1, 033	600758	辽宁能源	263, 900	960, 596. 00	0. 01
1, 034	601519	大智慧	74, 600	960, 102. 00	0. 01
1, 035	000589	贵州轮胎	184, 300	954, 674. 00	0. 01
1, 036	002922	伊戈尔	30, 400	930, 848. 00	0. 01
1, 037	605020	永和股份	33, 900	911, 571. 00	0. 01
1, 038	603737	三棵树	19, 700	911, 519. 00	0. 01
1, 039	002078	太阳纸业	57, 800	910, 350. 00	0. 01
1, 040	600478	科力远	130, 400	898, 456. 00	0. 01
1, 041	300088	长信科技	147, 400	893, 244. 00	0. 01
1, 042	002157	正邦科技	275, 300	891, 972. 00	0. 01
1, 043	300627	华测导航	25, 500	890, 205. 00	0. 01
1, 044	002539	云图控股	74, 800	884, 136. 00	0. 01
1, 045	002535	林州重机	227, 700	883, 476. 00	0. 01
1, 046	301345	涛涛车业	3, 500	879, 620. 00	0. 01
1, 047	300415	伊之密	33, 600	875, 616. 00	0. 01
1, 048	601619	嘉泽新能	197, 200	875, 568. 00	0. 01
1, 049	600100	同方股份	98, 100	875, 052. 00	0. 01
1, 050	300304	云意电气	75, 100	874, 164. 00	0. 01
1, 051	688516	奥特维	19, 097	864, 330. 22	0. 01
1, 052	002773	康弘药业	28, 700	860, 139. 00	0. 01
1, 053	601958	金铂股份	55, 000	856, 900. 00	0. 01
1, 054	600428	中远海特	120, 200	853, 420. 00	0. 01
1, 055	000598	兴蓉环境	118, 800	851, 796. 00	0. 01
1, 056	002434	万里扬	89, 000	848, 170. 00	0. 01
1, 057	000829	天音控股	76, 500	834, 615. 00	0. 01

1,058	601016	节能风电	281,100	829,245.00	0.01
1,059	603298	杭叉集团	31,200	828,984.00	0.01
1,060	603151	邦基科技	46,000	828,920.00	0.01
1,061	300642	透景生命	44,900	825,711.00	0.01
1,062	600689	上海三毛	61,100	821,184.00	0.01
1,063	600596	新安股份	71,400	818,958.00	0.01
1,064	603908	牧高笛	34,500	805,575.00	0.01
1,065	002249	大洋电机	73,900	805,510.00	0.01
1,066	603126	中材节能	119,400	802,368.00	0.01
1,067	300303	聚飞光电	116,900	799,596.00	0.01
1,067	603355	莱克电气	25,200	799,596.00	0.01
1,068	603341	龙旗科技	18,900	798,714.00	0.01
1,069	002127	南极电商	235,600	793,972.00	0.01
1,070	601019	山东出版	91,600	791,424.00	0.01
1,071	301039	中集车辆	86,200	788,730.00	0.01
1,072	300798	锦鸡股份	109,700	779,967.00	0.01
1,073	002835	同为股份	47,300	774,774.00	0.01
1,074	301031	中熔电气	6,900	774,111.00	0.01
1,075	688619	罗普特	56,891	773,717.60	0.01
1,076	000062	深圳华强	31,300	770,606.00	0.01
1,077	001277	速达股份	19,500	770,250.00	0.01
1,078	002603	以岭药业	45,000	768,150.00	0.01
1,079	688203	海正生材	59,271	757,483.38	0.01
1,080	002782	可立克	41,500	753,640.00	0.01
1,081	301178	天亿马	15,300	750,924.00	0.01
1,082	003025	思进智能	52,200	750,114.00	0.01
1,083	000922	佳电股份	53,900	741,664.00	0.01
1,084	600312	平高电气	42,400	735,640.00	0.01
1,085	001299	美能能源	49,900	734,029.00	0.01
1,086	002091	江苏国泰	80,600	727,818.00	0.01
1,087	600562	国睿科技	25,500	720,630.00	0.01
1,088	600901	江苏金租	117,400	718,488.00	0.01
1,089	603031	安孚科技	16,200	717,660.00	0.01
1,090	601375	中原证券	162,000	696,600.00	0.01
1,091	000818	航锦科技	35,700	689,010.00	0.01
1,092	603008	喜临门	33,400	684,032.00	0.01
1,093	301223	中荣股份	37,200	683,364.00	0.01
1,094	002797	第一创业	98,500	676,695.00	0.01
1,095	603278	大业股份	39,600	674,784.00	0.01
1,096	300735	光弘科技	26,800	666,248.00	0.01
1,097	600116	三峡水利	101,600	664,464.00	0.01
1,098	600535	天士力	44,000	663,080.00	0.01
1,099	600816	建元信托	232,300	657,409.00	0.01

1, 100	000672	上峰水泥	50,600	657,294.00	0.01
1, 101	688180	君实生物	19,202	655,940.32	0.01
1, 102	300882	万胜智能	34,800	654,240.00	0.01
1, 103	300834	星辉环材	28,000	649,040.00	0.01
1, 104	603926	铁流股份	38,000	648,660.00	0.01
1, 105	600295	鄂尔多斯	52,200	645,192.00	0.01
1, 106	603530	神马电力	15,700	644,956.00	0.01
1, 107	300696	爱乐达	20,200	644,582.00	0.01
1, 108	301380	挖金客	17,000	642,600.00	0.01
1, 109	600546	山煤国际	63,600	641,724.00	0.01
1, 110	301295	美硕科技	21,500	640,700.00	0.01
1, 111	600925	苏能股份	140,800	639,232.00	0.01
1, 112	600135	乐凯胶片	61,700	636,744.00	0.01
1, 113	688188	柏楚电子	4,684	636,508.76	0.01
1, 114	301022	海泰科	19,216	635,857.44	0.01
1, 115	601990	南京证券	80,100	634,392.00	0.01
1, 116	002598	山东章鼓	59,200	632,848.00	0.01
1, 117	600970	中材国际	60,900	632,751.00	0.01
1, 118	603617	君禾股份	83,900	632,606.00	0.01
1, 119	300323	华灿光电	78,500	626,430.00	0.01
1, 120	688229	博睿数据	9,971	624,982.28	0.01
1, 121	002979	雷赛智能	14,800	622,636.00	0.01
1, 122	301587	中瑞股份	26,600	622,440.00	0.01
1, 123	603085	天成自控	52,400	620,940.00	0.01
1, 124	301071	力量钻石	17,300	620,032.00	0.01
1, 125	002531	天顺风能	90,000	617,400.00	0.01
1, 126	605180	华生科技	42,300	615,465.00	0.01
1, 127	301000	肇民科技	15,600	614,172.00	0.01
1, 128	301233	盛帮股份	11,600	613,872.00	0.01
1, 129	300031	宝通科技	27,000	613,710.00	0.01
1, 130	603619	中曼石油	26,600	613,130.00	0.01
1, 131	301226	祥明智能	18,000	612,540.00	0.01
1, 132	688693	锆威特	16,356	612,368.64	0.01
1, 133	603081	大丰实业	43,600	611,708.00	0.01
1, 134	301003	江苏博云	13,700	611,020.00	0.01
1, 135	300809	华辰装备	16,000	609,120.00	0.01
1, 136	002849	威星智能	38,300	608,970.00	0.01
1, 137	301157	华塑科技	11,700	608,634.00	0.01
1, 138	301276	嘉曼服饰	20,300	608,594.00	0.01
1, 139	600665	天地源	185,400	608,112.00	0.01
1, 140	002786	银宝山新	70,700	608,020.00	0.01
1, 141	300740	水羊股份	25,500	607,920.00	0.01
1, 142	603022	新通联	59,000	605,930.00	0.01

1, 143	300549	优德精密	32, 100	605, 406. 00	0. 01
1, 144	600661	昂立教育	59, 000	604, 750. 00	0. 01
1, 145	300865	大宏立	22, 200	604, 506. 00	0. 01
1, 146	600727	鲁北化工	88, 100	602, 604. 00	0. 01
1, 147	001239	永达股份	36, 900	602, 208. 00	0. 01
1, 148	603067	振华股份	20, 900	602, 129. 00	0. 01
1, 149	603190	亚通精工	22, 300	601, 431. 00	0. 01
1, 150	301331	恩威医药	22, 700	600, 188. 00	0. 01
1, 151	600706	曲江文旅	56, 600	599, 960. 00	0. 01
1, 152	600215	派斯林	83, 900	599, 885. 00	0. 01
1, 153	301192	泰祥股份	20, 200	599, 738. 00	0. 01
1, 154	688589	力合微	26, 360	599, 690. 00	0. 01
1, 155	603533	掌阅科技	27, 100	599, 452. 00	0. 01
1, 156	301199	迈赫股份	25, 700	599, 324. 00	0. 01
1, 157	000803	山高环能	83, 800	599, 170. 00	0. 01
1, 158	300871	回盛生物	28, 900	599, 097. 00	0. 01
1, 159	600764	中国海防	21, 900	598, 746. 00	0. 01
1, 160	300861	美畅股份	40, 100	598, 693. 00	0. 01
1, 161	300849	锦盛新材	38, 300	598, 629. 00	0. 01
1, 162	001228	永泰运	22, 800	598, 272. 00	0. 01
1, 163	603730	岱美股份	68, 200	597, 432. 00	0. 01
1, 164	603042	华脉科技	35, 200	597, 344. 00	0. 01
1, 165	301600	慧翰股份	4, 600	597, 126. 00	0. 01
1, 166	301337	亚华电子	21, 700	596, 967. 00	0. 01
1, 167	300238	冠昊生物	43, 100	596, 935. 00	0. 01
1, 168	300005	探路者	55, 100	596, 733. 00	0. 01
1, 169	000411	英特集团	46, 800	596, 700. 00	0. 01
1, 170	603309	维力医疗	43, 900	596, 601. 00	0. 01
1, 171	688147	微导纳米	9, 495	596, 191. 05	0. 01
1, 172	600233	圆通速递	36, 300	596, 046. 00	0. 01
1, 173	688639	华恒生物	18, 293	595, 985. 94	0. 01
1, 174	300828	锐新科技	35, 400	595, 782. 00	0. 01
1, 175	603877	太平鸟	41, 000	595, 730. 00	0. 01
1, 176	688288	鸿泉技术	22, 218	595, 664. 58	0. 01
1, 177	603192	汇得科技	22, 700	595, 648. 00	0. 01
1, 178	300149	睿智医药	62, 300	595, 588. 00	0. 01
1, 179	002590	万安科技	39, 700	595, 500. 00	0. 01
1, 180	002623	亚玛顿	32, 900	595, 490. 00	0. 01
1, 181	600620	天宸股份	91, 600	595, 400. 00	0. 01
1, 182	300034	钢研高纳	30, 400	595, 232. 00	0. 01
1, 183	000620	盈新发展	222, 100	595, 228. 00	0. 01
1, 184	603980	吉华集团	118, 100	595, 224. 00	0. 01
1, 185	301088	戎美股份	34, 700	595, 105. 00	0. 01

1, 186	603896	寿仙谷	30, 700	594, 966. 00	0. 01
1, 187	688551	科威尔	16, 147	594, 694. 01	0. 01
1, 188	002440	闰土股份	79, 600	594, 612. 00	0. 01
1, 189	300813	泰林生物	24, 200	594, 594. 00	0. 01
1, 190	600876	凯盛新能	60, 300	594, 558. 00	0. 01
1, 191	603569	长久物流	77, 700	594, 405. 00	0. 01
1, 192	603089	正裕工业	46, 900	594, 223. 00	0. 01
1, 193	002057	中钢天源	58, 300	594, 077. 00	0. 01
1, 194	300328	宜安科技	34, 800	594, 036. 00	0. 01
1, 195	002895	川恒股份	16, 200	593, 892. 00	0. 01
1, 196	300942	易瑞生物	63, 100	593, 771. 00	0. 01
1, 197	603337	杰克科技	13, 700	593, 621. 00	0. 01
1, 198	603511	爱慕股份	38, 300	593, 267. 00	0. 01
1, 199	300987	川网传媒	35, 300	593, 040. 00	0. 01
1, 200	600851	海欣股份	86, 800	592, 844. 00	0. 01
1, 201	688586	江航装备	45, 456	592, 746. 24	0. 01
1, 202	603585	苏利股份	31, 400	592, 204. 00	0. 01
1, 203	603661	恒林股份	18, 500	592, 185. 00	0. 01
1, 204	603589	口子窖	19, 700	591, 985. 00	0. 01
1, 205	688106	金宏气体	30, 188	591, 382. 92	0. 01
1, 206	605377	华旺科技	69, 200	590, 968. 00	0. 01
1, 207	002446	盛路通信	56, 300	590, 587. 00	0. 01
1, 208	300416	苏试试验	33, 100	590, 504. 00	0. 01
1, 209	600461	洪城环境	63, 700	590, 499. 00	0. 01
1, 210	300906	日月明	16, 800	590, 352. 00	0. 01
1, 211	601678	滨化股份	139, 200	590, 208. 00	0. 01
1, 212	002965	祥鑫科技	14, 500	589, 860. 00	0. 01
1, 213	300640	德艺文创	76, 200	589, 788. 00	0. 01
1, 214	600232	金鹰股份	74, 500	589, 295. 00	0. 01
1, 215	603166	福达股份	37, 500	588, 750. 00	0. 01
1, 216	002017	东信和平	26, 400	588, 720. 00	0. 01
1, 217	603150	万朗磁塑	15, 500	588, 690. 00	0. 01
1, 218	605155	西大门	34, 200	588, 240. 00	0. 01
1, 219	002145	钛能化学	120, 000	588, 000. 00	0. 01
1, 220	603680	今创集团	38, 100	587, 121. 00	0. 01
1, 221	300383	光环新网	46, 900	586, 719. 00	0. 01
1, 222	300244	迪安诊断	37, 000	586, 450. 00	0. 01
1, 223	301325	曼恩斯特	11, 600	586, 380. 00	0. 01
1, 224	001229	魅视科技	13, 500	586, 170. 00	0. 01
1, 225	002139	拓邦股份	42, 500	585, 650. 00	0. 01
1, 226	002791	坚朗五金	27, 600	585, 396. 00	0. 01
1, 227	688123	聚辰股份	4, 654	584, 449. 32	0. 01
1, 228	300261	雅本化学	86, 800	584, 164. 00	0. 01

1, 229	301370	国科恒泰	50,000	584,000.00	0.01
1, 230	300468	四方精创	15,000	582,450.00	0.01
1, 231	600490	鹏欣资源	75,100	580,523.00	0.01
1, 232	600955	维远股份	35,800	579,960.00	0.01
1, 233	600316	洪都航空	16,600	579,506.00	0.01
1, 234	301225	恒勃股份	3,500	579,250.00	0.01
1, 235	300612	宣亚国际	32,500	578,825.00	0.01
1, 236	688220	翱捷科技	6,988	577,278.68	0.01
1, 237	600751	海航科技	150,600	576,798.00	0.01
1, 238	600552	凯盛科技	46,384	575,161.60	0.01
1, 239	002099	海翔药业	92,100	574,704.00	0.01
1, 240	688275	万润新能	7,621	574,623.40	0.01
1, 241	000155	川能动力	49,300	574,345.00	0.01
1, 242	603256	宏和科技	15,600	574,236.00	0.01
1, 243	300236	上海新阳	9,000	573,840.00	0.01
1, 244	605060	联德股份	15,500	572,880.00	0.01
1, 245	300964	本川智能	10,300	572,680.00	0.01
1, 246	688319	欧林生物	22,559	572,096.24	0.01
1, 247	002420	毅昌科技	74,000	569,060.00	0.01
1, 248	002296	辉煌科技	50,800	568,960.00	0.01
1, 249	002030	达安基因	95,400	568,584.00	0.01
1, 250	000917	电广传媒	55,100	566,428.00	0.01
1, 251	600438	通威股份	27,500	564,300.00	0.01
1, 252	600586	金晶科技	100,100	563,563.00	0.01
1, 253	601579	会稽山	27,800	563,506.00	0.01
1, 254	688682	霍莱沃	10,611	561,428.01	0.01
1, 255	300534	陇神戎发	59,200	561,216.00	0.01
1, 256	301505	苏州规划	25,200	561,204.00	0.01
1, 257	603882	金域医学	19,600	555,856.00	0.01
1, 258	601001	晋控煤业	42,100	553,615.00	0.01
1, 259	301069	凯盛新材	19,900	553,220.00	0.01
1, 260	688662	富信科技	10,794	553,192.50	0.01
1, 261	688353	华盛锂电	4,805	546,328.50	0.01
1, 262	000951	中国重汽	32,100	542,490.00	0.01
1, 263	001379	腾达科技	23,000	541,880.00	0.01
1, 264	300047	天源迪科	42,900	538,395.00	0.01
1, 265	300529	健帆生物	27,100	533,057.00	0.01
1, 266	002763	汇洁股份	73,440	530,236.80	0.01
1, 267	603939	益丰药房	24,400	529,968.00	0.01
1, 268	605122	四方新材	40,200	528,630.00	0.01
1, 269	601866	中远海发	209,600	528,192.00	0.01
1, 270	600871	石化油服	242,200	523,152.00	0.01
1, 271	605116	奥锐特	20,500	513,525.00	0.01

1,272	301281	科源制药	17,500	512,750.00	0.01
1,273	002194	武汉凡谷	38,000	495,900.00	0.01
1,274	002941	新疆交建	30,900	489,765.00	0.01
1,275	600968	海油发展	126,700	486,528.00	0.01
1,276	600033	福建高速	117,600	485,688.00	0.01
1,277	002153	石基信息	44,400	480,852.00	0.01
1,278	603816	顾家家居	15,600	479,544.00	0.01
1,279	600516	方大炭素	82,000	466,580.00	0.01
1,280	603002	宏昌电子	62,900	464,831.00	0.01
1,281	603985	恒润股份	29,600	451,104.00	0.01
1,282	600602	云赛智联	24,100	450,429.00	0.01
1,283	300180	华峰超纤	63,200	437,976.00	0.01
1,284	002423	中粮资本	37,400	437,580.00	0.01
1,285	002010	传化智联	74,400	432,264.00	0.01
1,286	000563	陕国投 A	125,200	431,940.00	0.01
1,287	002386	天原股份	79,000	428,970.00	0.01
1,288	600480	凌云股份	34,300	421,547.00	0.01
1,289	301285	鸿日达	6,200	420,236.00	0.01
1,290	600388	龙净环保	25,700	419,167.00	0.01
1,291	600210	紫江企业	56,200	413,070.00	0.01
1,292	600754	锦江酒店	16,300	411,901.00	0.01
1,293	600166	福田汽车	139,400	407,048.00	0.01
1,294	002354	天娱数科	62,900	400,673.00	0.01
1,295	600720	中交设计	52,900	381,938.00	0.01
1,296	600380	健康元	32,800	378,840.00	0.01
1,297	603708	家家悦	31,800	376,194.00	0.01
1,298	601966	玲珑轮胎	25,800	374,874.00	0.01
1,299	002242	九阳股份	35,400	369,576.00	0.01
1,300	002489	浙江永强	95,000	363,850.00	0.01
1,301	000837	秦川机床	27,700	356,776.00	0.01
1,302	002926	华西证券	37,700	349,856.00	0.01
1,303	300580	贝斯特	13,100	344,399.00	0.01
1,304	301087	可孚医疗	7,700	343,959.00	0.01
1,305	002755	奥赛康	20,800	339,664.00	0.01
1,306	603218	日月股份	25,600	339,200.00	0.01
1,307	002859	洁美科技	12,200	336,720.00	0.01
1,308	300768	迪普科技	18,100	335,393.00	0.01
1,309	688244	永信至诚	13,480	329,451.20	0.01
1,310	601038	一拖股份	22,900	324,493.00	0.01
1,311	002993	奥海科技	7,300	319,083.00	0.00
1,312	000727	冠捷科技	124,600	316,484.00	0.00
1,313	002984	森麒麟	14,300	302,731.00	0.00
1,314	002838	道恩股份	12,500	301,000.00	0.00

1,315	301565	中仑新材	12,300	296,922.00	0.00
1,316	603332	苏州龙杰	21,200	294,256.00	0.00
1,317	605179	一鸣食品	14,000	292,740.00	0.00
1,318	000035	中国天楹	52,500	289,800.00	0.00
1,319	300302	同有科技	15,700	284,798.00	0.00
1,320	300925	法本信息	12,900	273,996.00	0.00
1,321	301132	满坤科技	8,200	273,060.00	0.00
1,322	002258	利尔化学	20,100	262,305.00	0.00
1,323	600611	大众交通	48,000	262,080.00	0.00
1,324	600604	市北高新	46,700	258,718.00	0.00
1,325	002946	新乳业	13,500	250,155.00	0.00
1,326	605339	南侨食品	12,400	243,288.00	0.00
1,327	001236	弘业期货	22,600	239,560.00	0.00
1,328	300341	麦克奥迪	13,800	225,492.00	0.00
1,329	002346	柘中股份	11,000	223,410.00	0.00
1,330	688120	华海清科	1,480	222,118.40	0.00
1,331	301215	中汽股份	32,100	219,885.00	0.00
1,332	301251	威尔高	4,200	219,576.00	0.00
1,333	301366	一博科技	6,100	215,147.00	0.00
1,334	301263	泰恩康	7,400	214,526.00	0.00
1,335	603087	甘李药业	3,100	211,017.00	0.00
1,336	002517	恺英网络	9,600	209,952.00	0.00
1,337	002950	奥美医疗	19,000	207,480.00	0.00
1,338	002929	润建股份	5,200	207,012.00	0.00
1,339	600866	星湖科技	28,700	199,465.00	0.00
1,340	600864	哈投股份	28,700	190,281.00	0.00
1,341	603408	建霖家居	13,800	186,852.00	0.00
1,342	002195	岩山科技	26,300	186,467.00	0.00
1,343	603529	爱玛科技	6,200	184,140.00	0.00
1,344	603707	健友股份	19,200	173,376.00	0.00
1,345	300041	回天新材	15,600	172,848.00	0.00
1,346	600288	大恒科技	11,400	170,772.00	0.00
1,347	002739	万达电影	15,000	169,800.00	0.00
1,348	000998	隆平高科	17,300	161,928.00	0.00
1,349	600710	苏美达	14,700	158,907.00	0.00
1,350	002599	盛通股份	18,500	157,990.00	0.00
1,351	002821	凯莱英	1,700	157,981.00	0.00
1,352	001286	陕西能源	16,400	152,684.00	0.00
1,353	300679	电连技术	3,100	150,908.00	0.00
1,354	688099	晶晨股份	1,716	149,686.68	0.00
1,355	603027	千禾味业	15,100	148,433.00	0.00
1,356	688213	思特威	1,557	148,055.13	0.00
1,357	688019	安集科技	674	146,878.08	0.00

1,358	301175	中科环保	24,300	143,613.00	0.00
1,359	600536	中国软件	3,100	143,530.00	0.00
1,360	002558	巨人网络	3,200	138,528.00	0.00
1,361	300070	碧水源	34,300	134,456.00	0.00
1,362	688469	芯联集成	19,678	131,645.82	0.00
1,363	003039	顺控发展	8,200	130,626.00	0.00
1,364	600993	马应龙	4,600	128,800.00	0.00
1,365	600032	浙江新能	17,200	127,452.00	0.00
1,366	300972	万辰集团	600	120,642.00	0.00
1,367	603345	安井食品	1,500	118,920.00	0.00
1,368	688002	睿创微纳	1,165	117,432.00	0.00
1,369	002085	万丰奥威	7,300	116,873.00	0.00
1,370	688235	百济神州	432	116,035.20	0.00
1,371	601968	宝钢包装	21,600	115,344.00	0.00
1,372	002266	浙富控股	26,900	111,904.00	0.00
1,373	603638	艾迪精密	5,900	111,687.00	0.00
1,374	000799	酒鬼酒	1,900	103,702.00	0.00
1,375	688608	恒玄科技	452	102,576.88	0.00
1,376	000686	东北证券	10,900	101,588.00	0.00
1,377	300458	全志科技	2,400	100,872.00	0.00
1,378	601969	海南矿业	8,300	98,604.00	0.00
1,379	603271	永杰新材	2,300	94,484.00	0.00
1,380	603699	纽威股份	1,800	93,546.00	0.00
1,381	688439	振华风光	1,442	93,153.20	0.00
1,382	001696	宗申动力	4,200	91,098.00	0.00
1,383	002185	华天科技	8,200	89,954.00	0.00
1,384	300373	扬杰科技	1,300	88,400.00	0.00
1,385	002244	滨江集团	8,500	85,425.00	0.00
1,386	688578	艾力斯	771	80,299.65	0.00
1,387	002850	科达利	500	78,930.00	0.00
1,388	688301	奕瑞科技	768	77,652.48	0.00
1,389	600486	扬农化工	1,100	76,329.00	0.00
1,390	688615	合合信息	334	76,011.72	0.00
1,391	603605	珀莱雅	1,100	75,328.00	0.00
1,392	300017	网宿科技	7,300	74,825.00	0.00
1,393	603005	晶方科技	2,700	74,682.00	0.00
1,394	002003	伟星股份	7,000	74,200.00	0.00
1,395	600521	华海药业	4,300	72,971.00	0.00
1,396	002299	圣农发展	4,300	71,122.00	0.00
1,397	300623	捷捷微电	2,600	70,642.00	0.00
1,398	600909	华安证券	10,300	69,834.00	0.00
1,399	601216	君正集团	14,400	69,408.00	0.00
1,400	688777	中控技术	1,390	68,582.60	0.00

1,401	601677	明泰铝业	4,600	68,034.00	0.00
1,402	601238	广汽集团	8,300	67,728.00	0.00
1,403	000519	中兵红箭	3,700	67,377.00	0.00
1,404	300001	特锐德	2,600	66,768.00	0.00
1,405	300024	机器人	3,600	65,484.00	0.00
1,406	002065	东华软件	7,100	64,965.00	0.00
1,407	600663	陆家嘴	8,200	64,862.00	0.00
1,408	600332	白云山	2,500	64,350.00	0.00
1,409	688336	三生国健	1,068	63,620.76	0.00
1,410	002152	广电运通	4,600	63,526.00	0.00
1,411	600038	中直股份	1,700	61,421.00	0.00
1,412	300146	汤臣倍健	5,100	61,251.00	0.00
1,413	002312	川发龙蟒	5,600	61,208.00	0.00
1,414	600252	中恒集团	21,600	59,184.00	0.00
1,415	600095	湘财股份	5,300	58,618.00	0.00
1,416	603885	吉祥航空	3,900	58,032.00	0.00
1,417	688052	纳芯微	354	55,995.72	0.00
1,418	300296	利亚德	8,800	55,616.00	0.00
1,419	300487	蓝晓科技	900	55,575.00	0.00
1,420	002913	奥士康	1,300	55,562.00	0.00
1,421	002410	广联达	4,400	55,352.00	0.00
1,422	601567	三星医疗	2,400	55,248.00	0.00
1,423	002385	大北农	13,600	54,400.00	0.00
1,424	600171	上海贝岭	1,700	53,125.00	0.00
1,425	688692	达梦数据	200	52,254.00	0.00
1,426	300558	贝达药业	1,100	51,359.00	0.00
1,427	300674	宇信科技	2,100	50,946.00	0.00
1,428	601089	福元医药	2,100	50,400.00	0.00
1,429	600329	达仁堂	1,100	50,182.00	0.00
1,430	600008	首创环保	16,500	49,500.00	0.00
1,431	688266	泽璟制药	532	49,316.40	0.00
1,432	600873	梅花生物	4,700	47,611.00	0.00
1,433	603160	汇顶科技	600	47,400.00	0.00
1,434	000876	新希望	5,100	47,022.00	0.00
1,435	600023	浙能电力	9,000	44,550.00	0.00
1,436	000708	中信特钢	2,700	44,199.00	0.00
1,437	688003	天准科技	739	43,527.10	0.00
1,438	000581	威孚高科	2,100	43,302.00	0.00
1,439	300142	沃森生物	3,900	42,549.00	0.00
1,440	600390	五矿资本	7,600	42,180.00	0.00
1,441	600563	法拉电子	400	41,980.00	0.00
1,442	600773	西藏城投	3,300	40,887.00	0.00
1,443	000528	柳工	3,400	40,358.00	0.00

1,444	600995	南网储能	3,200	40,224.00	0.00
1,445	600750	华润江中	1,700	39,389.00	0.00
1,446	000928	中钢国际	5,900	38,999.00	0.00
1,447	603290	斯达半导	400	38,436.00	0.00
1,448	600378	昊华科技	1,200	38,352.00	0.00
1,449	002568	百润股份	1,700	37,077.00	0.00
1,450	601799	星宇股份	300	37,011.00	0.00
1,451	688278	特宝生物	441	36,902.88	0.00
1,452	600132	重庆啤酒	700	36,568.00	0.00
1,453	601965	中国汽研	2,200	36,520.00	0.00
1,454	600763	通策医疗	900	36,189.00	0.00
1,455	600517	国网英大	6,000	36,060.00	0.00
1,456	300957	贝泰妮	900	35,649.00	0.00
1,457	603233	大参林	2,000	35,240.00	0.00
1,458	688009	中国通号	6,390	34,953.30	0.00
1,459	688363	华熙生物	786	34,332.48	0.00
1,460	000058	深赛格	3,600	33,840.00	0.00
1,461	600004	白云机场	3,500	33,110.00	0.00
1,462	002978	安宁股份	1,000	33,050.00	0.00
1,463	688561	奇安信	928	33,018.24	0.00
1,464	688114	华大智造	536	32,567.36	0.00
1,465	002698	博实股份	1,900	31,939.00	0.00
1,466	000927	中国铁物	12,200	31,842.00	0.00
1,467	300676	华大基因	700	31,752.00	0.00
1,468	002314	南山控股	11,100	31,635.00	0.00
1,469	002372	伟星新材	3,000	31,290.00	0.00
1,470	000958	电投产融	4,800	31,056.00	0.00
1,471	000513	丽珠集团	900	31,014.00	0.00
1,472	688281	华秦科技	410	30,258.00	0.00
1,473	002075	沙钢股份	5,100	29,325.00	0.00
1,474	603688	石英股份	800	29,264.00	0.00
1,475	301029	怡合达	1,100	29,172.00	0.00
1,476	600511	国药股份	1,000	28,750.00	0.00
1,477	603927	中科软	1,500	28,635.00	0.00
1,478	000755	山西高速	5,700	28,614.00	0.00
1,479	002572	索菲亚	2,100	28,581.00	0.00
1,480	002557	洽洽食品	1,300	28,106.00	0.00
1,481	688798	艾为电子	365	27,780.15	0.00
1,482	688728	格科微	1,854	27,698.76	0.00
1,483	300613	富瀚微	600	27,636.00	0.00
1,484	000921	海信家电	1,100	27,291.00	0.00
1,485	000682	东方电子	2,300	27,278.00	0.00
1,486	002051	中工国际	3,000	27,210.00	0.00

1,487	300140	节能环保	4,000	27,080.00	0.00
1,488	603000	人民网	1,400	26,670.00	0.00
1,489	000029	深深房 A	1,200	26,424.00	0.00
1,490	002508	老板电器	1,300	25,155.00	0.00
1,491	600959	江苏有线	7,300	25,112.00	0.00
1,492	600056	中国医药	2,400	24,792.00	0.00
1,493	600621	华鑫股份	1,600	24,384.00	0.00
1,494	002007	华兰生物	1,600	24,208.00	0.00
1,495	600566	济川药业	900	23,670.00	0.00
1,496	600572	康恩贝	5,300	23,638.00	0.00
1,497	601000	唐山港	6,100	23,424.00	0.00
1,498	300888	稳健医疗	600	22,704.00	0.00
1,499	600906	财达证券	3,400	22,678.00	0.00
1,500	300601	康泰生物	1,500	22,155.00	0.00
1,501	600131	国网信通	1,300	20,982.00	0.00
1,502	603833	欧派家居	400	20,836.00	0.00
1,503	688475	萤石网络	685	20,625.35	0.00
1,504	600339	中油工程	6,100	20,435.00	0.00
1,505	600582	天地科技	3,500	20,405.00	0.00
1,506	600062	华润双鹤	1,100	20,119.00	0.00
1,507	000937	冀中能源	3,700	19,906.00	0.00
1,508	600483	福能股份	2,100	19,887.00	0.00
1,509	688097	博众精工	523	19,743.25	0.00
1,510	601928	凤凰传媒	1,900	19,076.00	0.00
1,510	603565	中谷物流	1,900	19,076.00	0.00
1,511	301207	华兰疫苗	1,000	18,630.00	0.00
1,512	002032	苏泊尔	400	17,632.00	0.00
1,513	002831	裕同科技	600	17,106.00	0.00
1,514	002608	江苏国信	2,200	16,258.00	0.00
1,515	002461	珠江啤酒	1,600	14,864.00	0.00
1,516	000539	粤电力 A	3,300	14,586.00	0.00
1,517	301301	川宁生物	1,400	14,196.00	0.00
1,518	603658	安图生物	400	14,168.00	0.00
1,519	601228	广州港	4,000	12,960.00	0.00
1,520	688819	天能股份	390	12,955.80	0.00
1,521	001213	中铁特货	3,000	12,150.00	0.00
1,522	600007	中国国贸	600	11,892.00	0.00
1,523	601139	深圳燃气	1,700	11,220.00	0.00
1,524	003035	南网能源	2,300	10,534.00	0.00
1,525	688349	三一重能	390	9,859.20	0.00
1,526	600874	创业环保	1,300	7,722.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300476	胜宏科技	443,520,619.16	13.61
2	002384	东山精密	366,843,514.52	11.26
3	300502	新易盛	336,053,054.42	10.31
4	300274	阳光电源	331,011,515.10	10.16
5	300014	亿纬锂能	285,862,569.92	8.77
6	300033	同花顺	261,960,098.13	8.04
7	300803	指南针	260,380,202.17	7.99
8	300750	宁德时代	240,238,725.37	7.37
9	601688	华泰证券	232,157,051.81	7.13
10	601012	隆基绿能	227,629,333.94	6.99
11	600919	江苏银行	221,883,129.74	6.81
12	300548	长芯博创	219,032,406.91	6.72
13	603986	兆易创新	218,417,113.58	6.70
14	603799	华友钴业	216,284,677.49	6.64
15	002475	立讯精密	200,222,794.19	6.15
16	600111	北方稀土	199,989,216.03	6.14
17	001309	德明利	199,004,441.16	6.11
18	000333	美的集团	196,443,812.19	6.03
19	601328	交通银行	195,769,157.00	6.01
20	300394	天孚通信	194,423,728.22	5.97
21	601138	工业富联	192,077,558.91	5.90
22	000338	潍柴动力	191,648,951.46	5.88
23	000063	中兴通讯	188,451,851.39	5.78
24	000568	泸州老窖	187,901,081.87	5.77
25	002600	领益智造	185,945,339.21	5.71
26	002709	天赐材料	185,794,165.79	5.70
27	688008	澜起科技	183,503,519.84	5.63
28	601009	南京银行	179,918,259.06	5.52
29	000651	格力电器	174,052,898.95	5.34
30	300308	中际旭创	173,162,952.51	5.32
31	002463	沪电股份	172,366,081.53	5.29
32	002281	光迅科技	172,108,248.45	5.28
33	002851	麦格米特	168,793,396.09	5.18
34	601668	中国建筑	165,777,662.26	5.09
35	600941	中国移动	165,524,184.57	5.08
36	600089	特变电工	161,736,589.88	4.96
37	603083	剑桥科技	159,214,554.50	4.89
38	601360	三六零	158,174,966.80	4.86

39	300124	汇川技术	157,733,663.19	4.84
40	603259	药明康德	153,920,563.97	4.72
41	601169	北京银行	153,351,087.32	4.71
42	603228	景旺电子	152,806,964.20	4.69
43	000977	浪潮信息	150,841,077.61	4.63
44	301308	江波龙	146,087,508.40	4.48
45	002436	兴森科技	146,063,623.28	4.48
46	300570	太辰光	145,742,959.90	4.47
47	002402	和而泰	142,608,762.21	4.38
48	688981	中芯国际	140,461,927.08	4.31
49	300450	先导智能	134,513,124.65	4.13
50	600926	杭州银行	131,274,663.62	4.03
51	300748	金力永磁	130,375,771.38	4.00
52	301511	德福科技	130,361,426.39	4.00
53	002241	歌尔股份	125,591,653.00	3.85
54	600699	均胜电子	124,739,869.07	3.83
55	600309	万华化学	124,222,938.32	3.81
56	301236	软通动力	121,718,131.93	3.74
57	300058	蓝色光标	120,091,254.17	3.69
58	600938	中国海油	117,079,941.00	3.59
59	600392	盛和资源	116,726,063.00	3.58
60	301358	湖南裕能	113,316,026.21	3.48
61	002074	国轩高科	112,339,458.43	3.45
62	688472	阿特斯	110,839,326.60	3.40
63	002966	苏州银行	110,175,113.86	3.38
64	002460	赣锋锂业	109,993,610.55	3.38
65	300475	香农芯创	108,746,456.01	3.34
66	688256	寒武纪	107,796,360.34	3.31
67	002466	天齐锂业	106,821,587.82	3.28
68	600183	生益科技	106,189,320.76	3.26
69	601689	拓普集团	105,850,704.27	3.25
70	601162	天风证券	105,614,867.00	3.24
71	000858	五粮液	105,384,360.20	3.23
72	002129	TCL 中环	103,399,987.49	3.17
73	002371	北方华创	102,828,695.39	3.16
74	000001	平安银行	100,064,359.00	3.07
75	002738	中矿资源	99,506,960.69	3.05
76	600096	云天化	99,434,095.00	3.05
77	601225	陕西煤业	99,107,277.22	3.04
78	601077	渝农商行	98,476,400.00	3.02
79	601336	新华保险	98,273,503.20	3.02
80	002273	水晶光电	97,775,702.99	3.00
81	600438	通威股份	97,369,422.58	2.99

82	002916	深南电路	97,345,952.39	2.99
83	600839	四川长虹	94,342,403.84	2.90
84	300339	润和软件	93,165,810.33	2.86
85	603893	瑞芯微	92,642,563.00	2.84
86	688012	中微公司	90,579,954.41	2.78
87	002670	国盛证券	88,396,790.90	2.71
88	601669	中国电建	88,197,155.00	2.71
89	002261	拓维信息	87,611,291.56	2.69
90	601869	长飞光纤	87,258,389.04	2.68
91	300418	昆仑万维	87,213,090.05	2.68
92	600795	国电电力	86,683,669.00	2.66
93	002459	晶澳科技	86,676,748.69	2.66
94	300207	欣旺达	86,611,729.92	2.66
95	002195	岩山科技	84,904,826.15	2.61
96	601318	中国平安	83,651,726.00	2.57
97	603185	弘元绿能	82,818,912.46	2.54
98	600021	上海电力	82,558,538.00	2.53
99	002837	英维克	81,853,148.50	2.51
100	000981	山子高科	80,923,544.00	2.48
101	300454	深信服	80,749,243.37	2.48
102	603019	中科曙光	78,918,983.55	2.42
103	603444	吉比特	78,749,331.52	2.42
104	002050	三花智控	78,193,978.00	2.40
105	688220	翱捷科技	77,468,635.43	2.38
106	300438	鹏辉能源	77,332,109.00	2.37
107	002812	恩捷股份	75,875,366.17	2.33
108	601919	中远海控	75,435,025.51	2.32
109	601888	中国中免	75,065,504.21	2.30
110	300870	欧陆通	74,206,080.14	2.28
111	300059	东方财富	73,864,623.00	2.27
112	600015	华夏银行	73,680,786.11	2.26
113	605499	东鹏饮料	73,566,903.89	2.26
114	600048	保利发展	72,752,351.21	2.23
115	300857	协创数据	72,640,527.00	2.23
116	300073	当升科技	72,169,487.57	2.22
117	688521	芯原股份	71,469,587.41	2.19
118	300204	舒泰神	71,327,494.00	2.19
119	000519	中兵红箭	70,654,822.01	2.17
120	600580	卧龙电驱	69,014,825.27	2.12
121	300496	中科创达	68,779,536.12	2.11
122	300170	汉得信息	68,016,763.48	2.09
123	601615	明阳智能	67,141,738.00	2.06
124	600690	海尔智家	66,778,811.79	2.05

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	634,361,507.39	19.47
2	002384	东山精密	411,530,693.19	12.63
3	300502	新易盛	378,534,680.01	11.62
4	300274	阳光电源	358,130,927.04	10.99
5	600919	江苏银行	265,476,852.87	8.15
6	300033	同花顺	252,347,643.11	7.75
7	603799	华友钴业	250,403,801.55	7.69
8	300548	长芯博创	250,014,756.02	7.67
9	300750	宁德时代	244,250,602.81	7.50
10	601688	华泰证券	242,731,145.86	7.45
11	603986	兆易创新	231,524,360.74	7.11
12	300803	指南针	227,466,632.70	6.98
13	300014	亿纬锂能	213,160,778.54	6.54
14	600111	北方稀土	210,314,463.18	6.46
15	688008	澜起科技	209,673,236.48	6.44
16	300394	天孚通信	204,859,514.95	6.29
17	000333	美的集团	197,609,096.87	6.07
18	002600	领益智造	197,127,818.45	6.05
19	000568	泸州老窖	195,588,735.90	6.00
20	300308	中际旭创	190,541,382.69	5.85
21	603259	药明康德	190,186,094.20	5.84
22	601328	交通银行	190,174,435.90	5.84
23	002475	立讯精密	187,778,173.32	5.76
24	002709	天赐材料	186,716,359.50	5.73
25	601009	南京银行	180,734,789.36	5.55
26	601138	工业富联	179,564,959.80	5.51
27	002460	赣锋锂业	178,617,786.53	5.48
28	002281	光迅科技	176,506,021.49	5.42
29	601012	隆基绿能	171,739,331.53	5.27
30	001309	德明利	171,442,950.34	5.26
31	600941	中国移动	166,224,796.65	5.10
32	000977	浪潮信息	163,005,665.96	5.00
33	603083	剑桥科技	162,723,803.81	4.99
34	601668	中国建筑	161,653,966.20	4.96
35	300124	汇川技术	148,086,095.13	4.55
36	688981	中芯国际	145,469,085.64	4.47
37	002241	歌尔股份	143,128,129.80	4.39
38	600699	均胜电子	141,598,955.67	4.35

39	601169	北京银行	139,913,203.20	4.29
40	000651	格力电器	139,852,012.79	4.29
41	002402	和而泰	139,737,781.13	4.29
42	002463	沪电股份	137,938,695.56	4.23
43	002851	麦格米特	136,006,049.86	4.17
44	601669	中国电建	128,651,800.93	3.95
45	600089	特变电工	126,362,187.27	3.88
46	301236	软通动力	125,778,269.80	3.86
47	600096	云天化	124,645,789.00	3.83
48	600309	万华化学	120,988,387.80	3.71
49	601336	新华保险	118,826,530.08	3.65
50	300748	金力永磁	117,766,975.34	3.61
51	601162	天风证券	117,366,073.00	3.60
52	688012	中微公司	115,460,991.44	3.54
53	601689	拓普集团	114,588,464.26	3.52
54	300570	太辰光	113,508,963.45	3.48
55	000063	中兴通讯	113,245,725.78	3.48
56	600938	中国海油	112,559,610.00	3.45
57	002436	兴森科技	111,185,199.56	3.41
58	600926	杭州银行	109,133,650.26	3.35
59	002916	深南电路	109,113,820.60	3.35
60	601077	渝农商行	108,383,856.00	3.33
61	688256	寒武纪	107,964,722.96	3.31
62	000338	潍柴动力	107,851,779.98	3.31
63	002966	苏州银行	107,764,373.34	3.31
64	000858	五粮液	104,954,671.26	3.22
65	603893	瑞芯微	102,406,726.05	3.14
66	300475	香农芯创	101,414,313.97	3.11
67	600839	四川长虹	101,395,552.11	3.11
68	601225	陕西煤业	101,203,913.68	3.11
69	600392	盛和资源	100,019,642.46	3.07
70	600438	通威股份	98,537,698.01	3.02
71	002466	天齐锂业	98,448,908.91	3.02
72	601360	三六零	97,981,477.00	3.01
73	000001	平安银行	97,759,807.00	3.00
74	300450	先导智能	97,420,271.00	2.99
75	600580	卧龙电驱	96,812,921.32	2.97
76	603228	景旺电子	95,605,933.82	2.93
77	002371	北方华创	93,359,720.33	2.87
78	603019	中科曙光	93,185,598.86	2.86
79	601615	明阳智能	91,492,615.44	2.81
80	300339	润和软件	90,656,450.61	2.78
81	002670	国盛证券	90,507,908.92	2.78

82	301511	德福科技	88,789,525.01	2.73
83	600795	国电电力	87,462,496.00	2.68
84	002273	水晶光电	87,309,241.65	2.68
85	002837	英维克	86,687,701.29	2.66
86	002261	拓维信息	82,475,208.21	2.53
87	002195	岩山科技	82,452,064.95	2.53
88	601318	中国平安	81,354,299.08	2.50
89	002050	三花智控	80,713,871.00	2.48
90	600570	恒生电子	80,484,135.64	2.47
91	601888	中国中免	80,083,857.78	2.46
92	688220	翱捷科技	79,220,557.41	2.43
93	600183	生益科技	78,527,158.07	2.41
94	300418	昆仑万维	78,514,467.97	2.41
95	300857	协创数据	78,435,249.86	2.41
96	002459	晶澳科技	78,046,340.33	2.40
97	300204	舒泰神	77,566,400.38	2.38
98	601919	中远海控	76,723,535.28	2.35
99	688521	芯原股份	75,851,295.79	2.33
100	300059	东方财富	75,051,549.42	2.30
101	605499	东鹏饮料	74,789,877.31	2.30
102	000981	山子高科	72,029,675.76	2.21
103	601006	大秦铁路	70,745,235.88	2.17
104	601898	中煤能源	68,769,231.46	2.11
105	601869	长飞光纤	68,731,449.04	2.11
106	600048	保利发展	68,704,129.00	2.11
107	600690	海尔智家	68,469,791.55	2.10
108	002812	恩捷股份	68,284,974.76	2.10
109	300170	汉得信息	67,353,909.99	2.07
110	600015	华夏银行	67,057,147.23	2.06
111	002738	中矿资源	66,015,305.44	2.03

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	37,966,668,851.09
卖出股票收入（成交）总额	36,882,851,587.95

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

无

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

无

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金报告期内未参与股指期货投资。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金报告期内未参与国债期货投资。

**8.11.2 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。

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

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

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,290,429.58
2	应收清算款	75,086,452.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,851,370.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,228,252.35

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国金量化多因子 A	150,711	7,184.66	112,778,535.12	10.42	970,028,189.85	89.58
国金量化多因子 C	103,094	10,489.93	477,623,065.55	44.17	603,825,542.29	55.83
合计	253,805	8,527.24	590,401,600.67	27.28	1,573,853,732.14	72.72

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金量化多因子 A	4,491,081.96	0.4148
	国金量化多因子 C	258,473.79	0.0239
	合计	4,749,555.75	0.2195

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

本基金基金经理持有 本开放式基金	国金量化多因子 A	>100
	国金量化多因子 C	0
	合计	>100

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

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

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多因子 A	国金量化多因子 C
基金合同生效日 (2018 年 10 月 31 日) 基金份额总额	249,293,966.03	-
本报告期期初基金 份额总额	1,177,839,970.30	433,713,441.73
本报告期基金总申 购份额	1,013,290,434.11	2,007,825,880.53
减：本报告期基金 总赎回份额	1,108,323,679.44	1,360,090,714.42
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金 份额总额	1,082,806,724.97	1,081,448,607.84

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

除上述人事调整以外，本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无其他重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为 75,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门调查或处罚。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	6,868,733,107.09	9.18	3,062,778.67	9.18	-
华泰证券	2	6,652,535,283.96	8.89	2,966,388.15	8.89	-
广发证券	2	5,820,840,145.85	7.78	2,595,523.39	7.78	-
东北证券	1	5,270,684,491.28	7.04	2,350,212.94	7.04	-

西南证券	2	5,222,397,096 .85	6.98	2,328,623.3 8	6.98	-
中信证券	2	4,815,309,657 .53	6.43	2,147,154.6 5	6.43	-
华创证券	1	3,566,629,852 .68	4.77	1,590,366.1 7	4.77	-
国海证券	2	3,253,461,810 .48	4.35	1,450,718.9 0	4.35	-
兴业证券	1	3,111,192,526 .80	4.16	1,387,274.9 6	4.16	-
国泰海通 证券	2	3,083,457,978 .81	4.12	1,374,901.2 5	4.12	-
浙商证券	1	3,068,259,054 .36	4.10	1,368,142.5 0	4.10	-
国金证券	1	2,692,587,212 .08	3.60	1,200,627.7 6	3.60	-
国信证券	1	2,528,897,223 .55	3.38	1,127,643.7 5	3.38	-
民生证券	2	2,510,967,895 .02	3.35	1,119,647.4 4	3.35	-
中信建投 证券	2	2,495,760,248 .98	3.33	1,112,862.2 8	3.33	-
国联民生 证券	1	2,284,419,393 .42	3.05	1,018,600.8 9	3.05	-
东吴证券	1	2,255,836,337 .18	3.01	1,005,868.0 2	3.01	-
天风证券	1	2,009,970,644 .97	2.69	896,242.66	2.69	-
华福证券	1	1,608,457,859 .35	2.15	717,212.14	2.15	-
申万宏源 证券	1	1,419,466,736 .07	1.90	632,943.94	1.90	-
华安证券	1	1,300,010,568 .32	1.74	579,670.91	1.74	-
国投证券	1	1,152,962,528 .27	1.54	514,110.00	1.54	-
中邮证券	2	716,173,843.7 8	0.96	319,345.41	0.96	-
光大证券	1	609,448,087.4 8	0.81	271,755.00	0.81	-
招商证券	2	531,060,854.8 8	0.71	236,801.80	0.71	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
金融街证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：（一）选择标准

1. 具备相关业务资质，公司经营行为规范；
2. 财务状况良好，公司经营状况稳定；
3. 具备较强的交易服务能力，相关制度建设、人员配置、系统建设等满足基金进行证券交易的需  
要；
4. 具备较强的研究服务能力，相关制度建设、人员配置、研究能力、研究质量等可以保障较  
为专业、审慎的研究服务；
5. 具备较强的合规风控能力，合规风控管理体系机制较为健全；
6. 交易佣金费率标准符合要求。

（二）选择程序

1. 基金管理人根据上述标准选用符合条件的证券公司；
2. 基金管理人和被选用的证券公司签订协议。

（三）变更情况

本基金本报告期新增国海证券、财通证券、东吴证券、中邮证券、华西证券、西南证券共 8 个交易单元，减少英大证券、首创证券共 2 个交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额	成交金额	占当期 债券回 购成交	成交金额	占当期 权证 成交总

		的比例 (%)		总额的 比例(%)		额的比 例(%)
长江证券	-	-	3,346,793,000.00	10.81	-	-
华泰证券	-	-	2,617,340,000.00	8.46	-	-
广发证券	-	-	2,625,899,000.00	8.48	-	-
东北证券	-	-	1,419,938,000.00	4.59	-	-
西南证券	-	-	1,817,951,000.00	5.87	-	-
中信证券	-	-	1,512,945,000.00	4.89	-	-
华创证券	-	-	1,077,454,000.00	3.48	-	-
国海证券	-	-	1,461,553,000.00	4.72	-	-
兴业证券	-	-	1,565,700,000.00	5.06	-	-
国泰海通 证券	-	-	1,238,529,000.00	4.00	-	-
浙商证券	-	-	1,791,400,000.00	5.79	-	-
国金证券	-	-	1,654,800,000.00	5.35	-	-
国信证券	-	-	491,946,000.00	1.59	-	-
民生证券	-	-	872,835,000.00	2.82	-	-
中信建投 证券	-	-	945,263,000.00	3.05	-	-
国联民生 证券	-	-	1,729,900,000.00	5.59	-	-
东吴证券	-	-	1,426,600,000.00	4.61	-	-
天风证券	-	-	842,100,000.00	2.72	-	-
华福证券	-	-	447,608,000.00	1.45	-	-
申万宏源 证券	-	-	244,556,000.00	0.79	-	-
华安证券	-	-	767,100,000.00	2.48	-	-
国投证券	-	-	170,411,000.00	0.55	-	-
中邮证券	-	-	154,239,000.00	0.50	-	-
光大证券	-	-	424,899,000.00	1.37	-	-

招商证券	-	-	306,439,000.00	0.99	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
金融街证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年1月17日
2	《国金量化多因子股票型证券投资 基金（国金量化多因子A类份额） 基金产品资料概要更新》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年1月17日
3	《国金量化多因子股票型证券投资 基金（国金量化多因子C类份额） 基金产品资料概要更新》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年1月17日
4	《国金量化多因子股票型证券投资 基金 2024 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年1月22日
5	《国金基金管理有限公司关于关闭 微信交易平台的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年2月7日
6	《国金基金管理有限公司关于公司 系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年2月20日
7	《国金基金管理有限公司关于终止 厦门市鑫鼎盛控股有限公司办理旗 下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年3月11日
8	《关于国金基金管理公司旗下部分 指数基金指数使用费调整为基金管 理人承担并修订基金合同的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025年3月20日
9	《国金量化多因子股票型证券投资	指定披露媒体和本基金	2025年3月28日

	基金 2024 年年度报告》	基金管理人网站	
10	《国金基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 31 日
11	《国金基金管理有限公司关于运用公司自有资金和高级管理人员自有资金投资旗下权益基金的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 14 日
12	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
13	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 25 日
14	《关于对单个基金账户国金量化多因子股票型证券投资基金限制大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 6 月 18 日
15	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新个人资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 1 日
16	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 19 日
17	《关于对单个基金账户国金量化多因子股票型证券投资基金大额申购、转换转入及定期定额投资业务金额上限调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 24 日
18	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年中期报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 8 月 30 日
19	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 10 月 28 日
20	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 12 月 19 日
21	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新个人资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日