

国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：广发证券股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中的财务资料已经审计，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	49

8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	68
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金智享量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	国金智享量化选股混合	
基金主代码	018823	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 22 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1,066,073,924.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
下属分级基金的交 易代码	018823	018824
报告期末下属分级 基金的份额总额	465,678,346.10 份	600,395,578.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过量化方法综合考虑标的中长期的表现，优选具有超额收益的个股构建投资组合，力求为基金份额持有人获取持续稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、固定收益品种投资策略、衍生品投资策略。 股票投资策略部分，本基金“自上而下”构建选股模型，在风险模型约束下，紧密跟踪基准，严格控制运作风险，并根据各个子模型一定时期内的表现情况对其迭代，提高整体模型的适应能力，目标取得持续稳定的超额收益。本基金将依据经济基本面、市场情绪等相对基础的数据出发，构建模型选取中长周期具有超额收益的个股构成股票投资组合。选股模型不仅从盈利和营业收入等角度评估上市公司的价值和成长性，同时充分考虑市场情绪等因素为标的合理定价。 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。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

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	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	虞志海	罗琦
	联系电话	010-88005852	020-66338888
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	gzluoqi@gf.com.cn

客户服务电话	4000-2000-18	95575
传真	010-88005666	020-87553363-6847
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
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	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码	100026	510627
法定代表人	邰海波	林传辉

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办公场所

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	2024 年		2023 年 8 月 22 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
本期已实现收益	-34,866,239.25	-48,726,275.36	-24,346,750.03	-34,403,074.35
本期利润	-3,332,368.76	-13,472,118.74	-50,321,963.62	-69,276,467.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0054	-0.0170	-0.0602	-0.0619
本期加权平均净值利润率	-0.62%	-1.96%	-6.19%	-6.37%
本期基金份额净值增长率	2.50%	1.99%	-6.00%	-6.17%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	-20,516,469.11	-30,340,844.44	-46,799,162.35	-62,474,786.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0441	-0.0505	-0.0600	-0.0617

期末基金资产净值	448,678,846.41	574,548,929.02	733,657,638.18	950,854,904.02
期末基金份额净值	0.9635	0.9570	0.9400	0.9383
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-3.65%	-4.30%	-6.00%	-6.17%

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

国金智享量化选股混合 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	0.96%	1.64%	-0.55%	1.42%	1.51%	0.22%
过去六个月	15.36%	1.54%	12.51%	1.37%	2.85%	0.17%
过去一年	2.50%	1.42%	11.97%	1.14%	-9.47%	0.28%
自基金合同生效起至今	-3.65%	1.28%	5.75%	1.03%	-9.40%	0.25%

国金智享量化选股混合 C

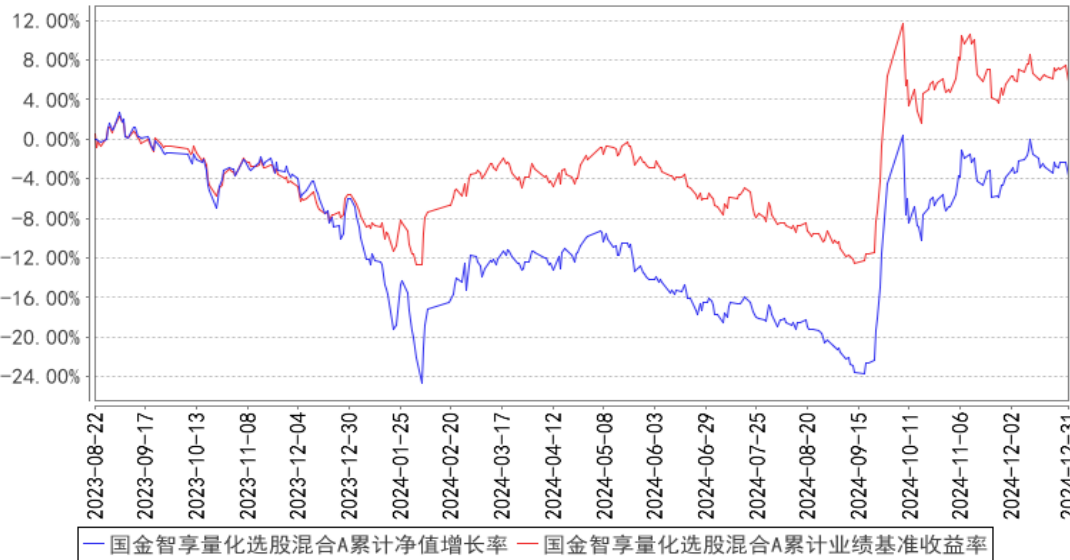
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.84%	1.64%	-0.55%	1.42%	1.39%	0.22%
过去六个月	15.07%	1.54%	12.51%	1.37%	2.56%	0.17%
过去一年	1.99%	1.42%	11.97%	1.14%	-9.98%	0.28%

自基金合同生效 起至今	-4.30%	1.28%	5.75%	1.03%	-10.05%	0.25%
----------------	--------	-------	-------	-------	---------	-------

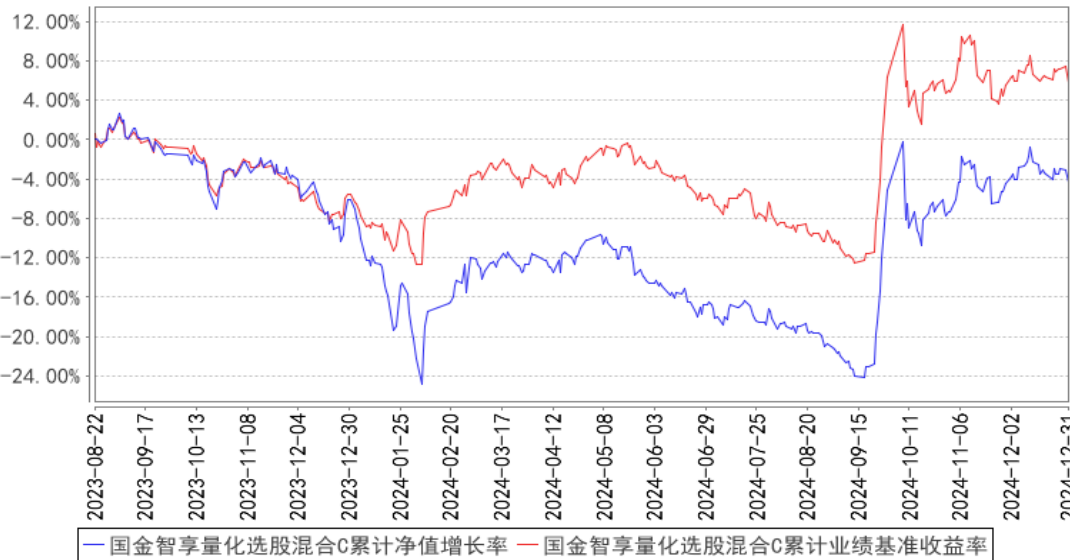
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

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

国金智享量化选股混合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



国金智享量化选股混合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

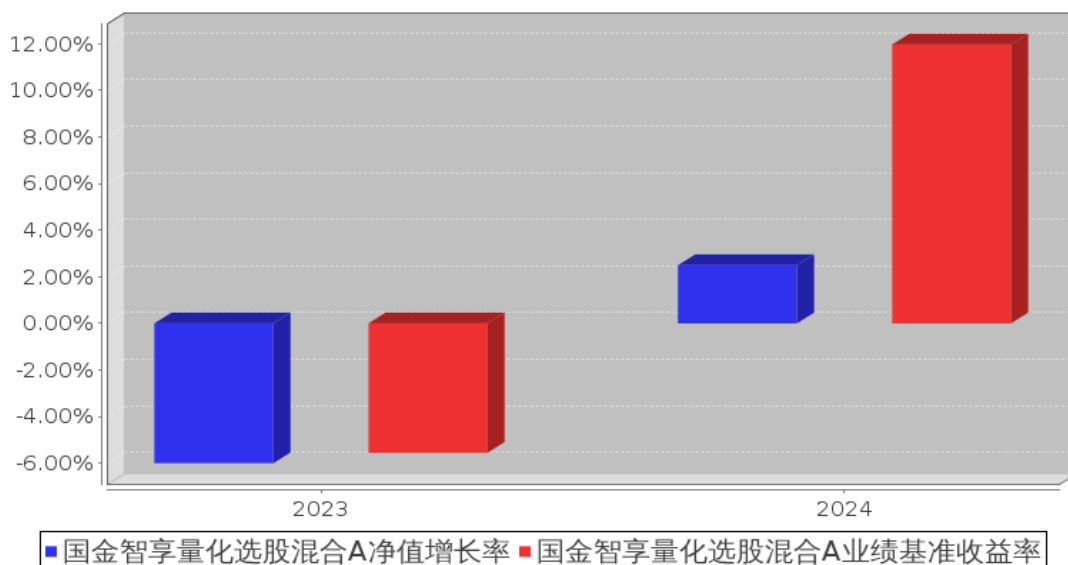


注：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，图示日期为 2023 年 8 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日。

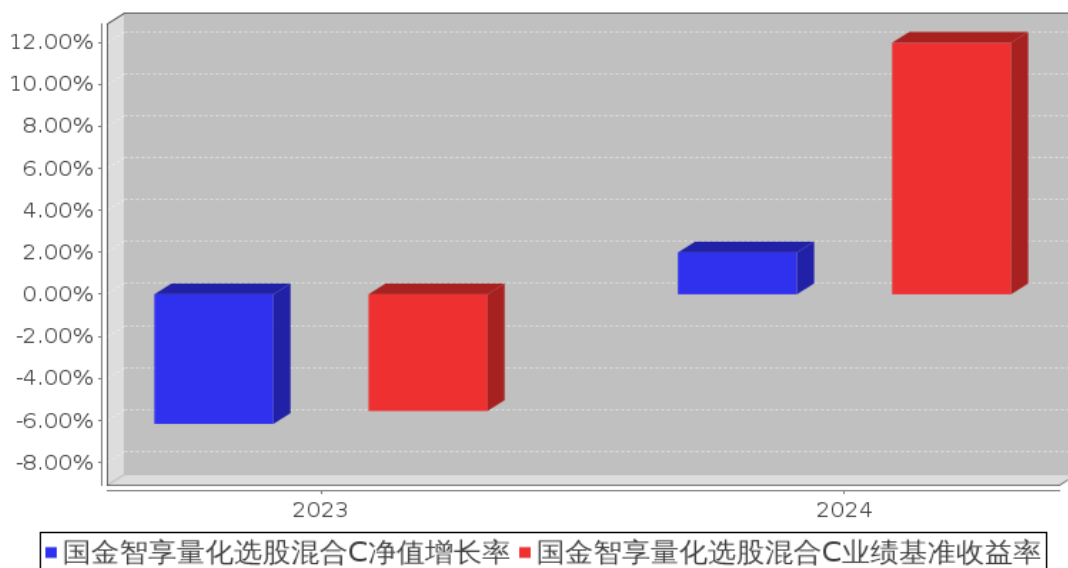
2、本基金建仓期为 2023 年 8 月 22 日至 2024 年 2 月 21 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

国金智享量化选股混合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



国金智享量化选股混合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 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 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2024年12月31日，国金基金管理有限公司共管理27只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金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。

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	2023年8月22日	-	8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。
--	--	--	--	--	--

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。

4.2 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《国金智享量化选股混合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；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 6 次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年，市场波动和活跃度均突破近十年历史极值：2 月初和 10 月上旬的市场波动高于近十

年历史极值，其余大部分时段的市场波动处于市场均值或高于均值的位置；市场活跃度于 10 月初达到近十年极值，9 月下旬以来维持在历史较高水平位置。具体因子方面，贝塔值、市值和动量等因子表现较为极端，波动较大。行业涨跌方面，大部分行业（中信一级行业）在报告期内录得上涨收益，其中涨幅大于 30% 的行业为银行、非银金融和家电等；综合、医药和农林牧渔等行业跌幅较大，最大跌幅 19% 以上。

随着机构投资者参与 A 股市场的占比提升，投资理念和方法论趋于完善，各类计算机技术和模型等广泛应用，市场有效性将进一步提升。在市场趋于成熟的过程中，风险模型的成熟度亦需日趋完备，这也是国金量化模型重点迭代优化的方向。

报告期内，本基金在风险模型迭代优化后的表现符合预期，一定程度回补了年初的回撤。国金量化策略收益来源多样化、持仓分散度较高，本基金在控制风险的基础上力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

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 0.9635 元，累计单位净值为 0.9635 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 2.50%，同期业绩比较基准增长率为 11.97%。

本基金 C 类份额单位净值为 0.9570 元，累计单位净值为 0.9570 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准增长率为 11.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

结合宏观和中观等多方面信息分析，A 股市场或将延续复杂多变、风格切换较为频繁的趋势。公募量化多头产品以获取超越业绩比较基准的投资回报为目标，通过持续优化风险模型，一定程度上有利于产品提升相对优势。

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，本基金托管人在对国金智享量化选股混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，国金基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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

本基金托管人依法对国金基金管理有限公司编制和披露的国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年年度报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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(2025)审字第 70015670_A09 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	国金智享量化选股混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金智享量化选股混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金智享量化选股混合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，公允反映了国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金智享量化选股混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们

	获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	国金智享量化选股混合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。 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。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时，管理层负责评估国金智享量化选股混合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。 治理层负责监督国金智享量化选股混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。 （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。 （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，就可能导致对国金智享量化选股混合

	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智享量化选股混合型证券投资基金不能持续经营。 （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。 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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	宋雪强	马剑英
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2025年3月28日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	117,546,075.41	133,677,132.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	910,783,080.22	1,557,580,752.38
其中：股票投资		910,783,080.22	1,557,580,752.38
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	-	-345.30
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,215.37	748,728.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,028,339,371.00	1,692,006,268.00
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,506,388.93	4,906,695.01
应付管理人报酬		1,085,792.07	1,772,950.49
应付托管费		180,965.35	295,491.76
应付销售服务费		253,073.21	418,525.20
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	85,376.01	100,063.34
负债合计		5,111,595.57	7,493,725.80
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	1,066,073,924.35	1,793,786,490.66
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-42,846,148.92	-109,273,948.46
净资产合计		1,023,227,775.43	1,684,512,542.20
负债和净资产总计		1,028,339,371.00	1,692,006,268.00

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，国金智享量化选股混合 A 基金份额净值 0.9635 元，基金份额总额 465,678,346.10 份；国金智享量化选股混合 C 基金份额净值 0.9570 元，基金份额总额 600,395,578.25 份。国金智享量化选股混合份额总额合计为 1,066,073,924.35 份。

7.2 利润表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金 合同生效日）至 2023 年
-----	-----	---	---

			12 月 31 日
一、营业总收入		4,027,071.92	-107,981,180.20
1. 利息收入		536,491.84	818,940.16
其中：存款利息收入	7.4.7.13	503,585.60	656,526.58
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		32,906.24	162,413.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-63,999,007.71	-48,189,226.31
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-93,031,955.16	-51,151,989.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	29,032,947.45	2,962,762.97
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	66,788,027.11	-60,848,606.86
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	701,560.68	237,712.81
减：二、营业总支出		20,831,559.42	11,617,251.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,725,673.53	8,199,501.57
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,454,278.84	1,366,583.57
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,446,607.05	1,955,765.90
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	205,000.00	95,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,804,487.50	-119,598,431.24

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,804,487.50	-119,598,431.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16,804,487.50	-119,598,431.24

7.3 净资产变动表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	1,793,786,490.66	-	-109,273,948.46	1,684,512,542.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,793,786,490.66	-	-109,273,948.46	1,684,512,542.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-727,712,566.31	-	66,427,799.54	-661,284,766.77
（一）、综合收益总额	-	-	-16,804,487.50	-16,804,487.50
（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）	-727,712,566.31	-	83,232,287.04	-644,480,279.27
其中：1. 基金申购款	116,544,835.17	-	-16,609,548.35	99,935,286.82
2. 基金赎回款	-844,257,401.48	-	99,841,835.39	-744,415,566.09
（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	1,066,073,924.35	-	-42,846,148.92	1,023,227,775.43
项目	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,992,048,014.27	-	-	1,992,048,014.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-198,261,523.61	-	-109,273,948.46	-307,535,472.07
（一）、综合收益总额	-	-	-119,598,431.24	-119,598,431.24
（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）	-198,261,523.61	-	10,324,482.78	-187,937,040.83
其中：1. 基金申购款	57,917,099.18	-	-2,410,635.90	55,506,463.28
2. 基金赎回款	-256,178,622.79	-	12,735,118.68	-243,443,504.11
（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	1,793,786,490.66	-	-109,273,948.46	1,684,512,542.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邵海波
基金管理人负责人

聂武鹏
主管会计工作负责人

于晓莲
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金智享量化选股混合型证券投资基金（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[2023]1358 号文《关于准予国金智享量化选股混合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 2023 年 8 月 22 日正式生效，本基金首次设立募集规模为 1,992,048,014.27 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，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例范围为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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；

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	19,490,409.03	9,981,854.22
等于：本金	19,485,366.77	9,973,930.10
加：应计利息	5,042.26	7,924.12
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	98,055,666.38	123,695,278.30
等于：本金	98,044,173.66	123,683,498.86
加：应计利息	11,492.72	11,779.44
减：坏账准备	-	-
合计	117,546,075.41	133,677,132.52

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		904,843,659.97	-	910,783,080.22	5,939,420.25
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		904,843,659.97	-	910,783,080.22	5,939,420.25
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,618,429,359.24	-	1,557,580,752.38	-60,848,606.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,618,429,359.24	-	1,557,580,752.38	-60,848,606.86

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 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-345.30	-
银行间市场	-	-
合计	-345.30	-

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

无

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	376.01	5,063.34
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	85,000.00	95,000.00
合计	85,376.01	100,063.34

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金智享量化选股混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	780,456,800.53	780,456,800.53
本期申购	53,117,506.95	53,117,506.95
本期赎回（以“-”号填列）	-367,895,961.38	-367,895,961.38
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	465,678,346.10	465,678,346.10

国金智享量化选股混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,013,329,690.13	1,013,329,690.13
本期申购	63,427,328.22	63,427,328.22
本期赎回（以“-”号填列）	-476,361,440.10	-476,361,440.10
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	600,395,578.25	600,395,578.25

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

国金智享量化选股混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22,879,659.72	-23,919,502.63	-46,799,162.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-22,879,659.72	-23,919,502.63	-46,799,162.35
本期利润	-34,866,239.25	31,533,870.49	-3,332,368.76
本期基金份额交易产生的变动数	37,229,429.86	-4,097,398.44	33,132,031.42
其中：基金申购款	-6,061,764.98	-3,604,789.60	-9,666,554.58
基金赎回款	43,291,194.84	-492,608.84	42,798,586.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,516,469.11	3,516,969.42	-16,999,499.69

国金智享量化选股混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-31,438,043.57	-31,036,742.54	-62,474,786.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-31,438,043.57	-31,036,742.54	-62,474,786.11
本期利润	-48,726,275.36	35,254,156.62	-13,472,118.74
本期基金份额交易产生的变动数	49,823,474.49	276,781.13	50,100,255.62
其中：基金申购款	-6,130,484.23	-812,509.54	-6,942,993.77
基金赎回款	55,953,958.72	1,089,290.67	57,043,249.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,340,844.44	4,494,195.21	-25,846,649.23

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	162,450.02	505,421.61
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	341,135.58	151,104.97
结算备付金利息收入	-	-

其他	-	-
合计	503, 585. 60	656, 526. 58

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-93, 031, 955. 16	-51, 151, 989. 28
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	-93, 031, 955. 16	-51, 151, 989. 28

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年8月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	15, 883, 397, 507. 26	3, 231, 590, 604. 76
减：卖出股票成本总额	15, 951, 435, 848. 86	3, 276, 358, 336. 24
减：交易费用	24, 993, 613. 56	6, 384, 257. 80
买卖股票差价收入	-93, 031, 955. 16	-51, 151, 989. 28

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

无

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利 收益	29,032,947.45	2,962,762.97

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	29,032,947.45	2,962,762.97

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	66,788,027.11	-60,848,606.86
股票投资	66,788,027.11	-60,848,606.86
债券投资	-	-
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	66,788,027.11	-60,848,606.86

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	457,979.55	186,935.43
基金转换费收入	243,581.13	50,777.38
合计	701,560.68	237,712.81

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日） 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	85,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	45,000.00

证券出借违约金	-	-
其他	-	400.00
合计	205,000.00	95,400.00

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
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构、基金结算机构

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023年8月22日（基金合同生效日）至2023 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 (%)
广发证券股份有限公司	31,121,247,656.85	100.00	8,126,378,300.24	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

无

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年8月22日（基金合同生效日）至2023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 (%)
广发证券股份有限公司	388,091,000.00	100.00	1,899,907,000.00	100.00

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 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 (%)
广发证券股份有限公司	15,056,608.38	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年8月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	4,238,151.06	100.00	-	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,725,673.53	8,199,501.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,254,989.01	4,016,024.31
应支付基金管理人的净管理费	7,470,684.52	4,183,477.26

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。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,454,278.84	1,366,583.57

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

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C	合计
国金基金管理有限公司	-	3,932.65	3,932.65
国金证券股份有限公司	-	79.51	79.51
广发证券股份有限公司	-	3,256,341.69	3,256,341.69
合计	-	3,260,353.85	3,260,353.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C	合计
国金基金管理有限公司	-	4,333.21	4,333.21
国金证券股份有限公司	-	86.13	86.13
广发证券股份有限公司	-	1,807,746.67	1,807,746.67
合计	-	1,812,166.01	1,812,166.01

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 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年8月22日（基金合同生效日）至2023 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
广发证券股份有限公司-活期存款	19,490,409.03	162,450.02	9,981,854.22	505,421.61
广发证券股份有限公司-其他存款	98,055,666.38	341,135.58	123,695,278.30	151,104.97

注：1. 本基金的其他存款为存放在开立于基金结算机构证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2. 除其他存款外，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（2024 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 2024 年 12 月	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
--------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

31 日							
资产							
货币资金	117,546,075.41	-	-	-	-	-	117,546,075.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	910,783,080.22	910,783,080.22
应收申购款	-	-	-	-	-	10,215.37	10,215.37
资产总计	117,546,075.41	-	-	-	-	910,793,295.59	1,028,339,371.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,506,388.93	3,506,388.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,085,792.07	1,085,792.07
应付托管费	-	-	-	-	-	180,965.35	180,965.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	253,073.21	253,073.21
其他负债	-	-	-	-	-	85,376.01	85,376.01
负债总计	-	-	-	-	-	5,111,595.57	5,111,595.57
利率敏感度缺口	117,546,075.41	-	-	-	-	905,681,700.02	1,023,227,775.43
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	133,677,132.52	-	-	-	-	-	133,677,132.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,557,580,752.38	1,557,580,752.38
买入返售金融资产	-345.30	-	-	-	-	-	-345.30
应收申购款	-	-	-	-	-	748,728.40	748,728.40
资产总计	133,676,787.22	-	-	-	-	-1,558,329,480.78	1,692,006,268.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,906,695.01	4,906,695.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,772,950.49	1,772,950.49
应付托管费	-	-	-	-	-	295,491.76	295,491.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	418,525.20	418,525.20
其他负债	-	-	-	-	-	100,063.34	100,063.34
负债总计	-	-	-	-	-	7,493,725.80	7,493,725.80
利率敏感度缺口	133,676,787.22	-	-	-	-	-1,550,835,754.98	1,684,512,542.20

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和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	910,783,080.22	89.01	1,557,580,752.38	92.46
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	910,783,080.22	89.01	1,557,580,752.38	92.46

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 800 指数（000906.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 800 指数数据回归得出，反映了基金和中证 800 指数的相关性。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	+5%	47, 023, 057. 38	72, 194, 939. 97
	-5%	-47, 023, 057. 38	-72, 194, 939. 97

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	910, 783, 080. 22	1, 557, 580, 752. 38
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	910, 783, 080. 22	1, 557, 580, 752. 38

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

无

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 2025 年 3 月 28 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	910,783,080.22	88.57
	其中：股票	910,783,080.22	88.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	117,546,075.41	11.43
8	其他各项资产	10,215.37	0.00

9	合计	1,028,339,371.00	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	7,196,851.00	0.70
B	采矿业	11,978,488.22	1.17
C	制造业	482,148,348.48	47.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,495,296.00	1.91
E	建筑业	48,532,498.57	4.74
F	批发和零售业	15,823,886.00	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	116,662,740.75	11.40
H	住宿和餐饮业	1,603,187.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,989,773.62	2.54
J	金融业	151,517,623.63	14.81
K	房地产业	180,412.00	0.02
L	租赁和商务服务业	23,986,466.00	2.34
M	科学研究和技术服务业	2,056,330.24	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	3,532,710.71	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	78,468.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	910,783,080.22	89.01

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	600919	江苏银行	3,270,611	32,117,400.02	3.14
2	600519	贵州茅台	18,800	28,651,200.00	2.80
3	601006	大秦铁路	4,196,000	28,448,880.00	2.78
4	000725	京东方A	6,427,900	28,218,481.00	2.76
5	000338	潍柴动力	2,059,488	28,214,985.60	2.76
6	601111	中国国航	3,564,800	28,197,568.00	2.76
7	600887	伊利股份	933,955	28,186,761.90	2.75

8	601669	中国电建	5,144,600	28,089,516.00	2.75
9	000651	格力电器	616,800	28,033,560.00	2.74
10	600015	华夏银行	3,327,521	26,653,443.21	2.60
11	000858	五 粮 液	172,900	24,212,916.00	2.37
12	601888	中国中免	347,400	23,279,274.00	2.28
13	601688	华泰证券	1,248,300	21,957,597.00	2.15
14	600309	万华化学	293,700	20,955,495.00	2.05
15	600941	中国移动	175,300	20,713,448.00	2.02
16	601009	南京银行	1,904,392	20,281,774.80	1.98
17	601377	兴业证券	2,961,510	18,539,052.60	1.81
18	002415	海康威视	574,433	17,635,093.10	1.72
19	600600	青岛啤酒	205,200	16,604,784.00	1.62
20	601868	中国能建	7,102,233	16,264,113.57	1.59
21	600115	中国东航	3,982,290	15,929,160.00	1.56
22	600346	恒力石化	904,900	13,890,215.00	1.36
23	000166	申万宏源	2,227,100	11,914,985.00	1.16
24	600029	南方航空	1,681,000	10,909,690.00	1.07
25	600009	上海机场	299,901	10,241,619.15	1.00
26	600372	中航机载	695,485	8,575,330.05	0.84
27	600926	杭州银行	554,100	8,095,401.00	0.79
28	601012	隆基绿能	473,900	7,444,969.00	0.73
29	000568	泸州老窖	53,400	6,685,680.00	0.65
30	600188	兖矿能源	470,500	6,666,985.00	0.65
31	000895	双汇发展	218,200	5,664,472.00	0.55
32	600305	恒顺醋业	672,700	5,368,146.00	0.52
33	688159	有方科技	176,465	5,336,301.60	0.52
34	600436	片仔癀	24,017	5,151,646.50	0.50
35	002304	洋河股份	61,400	5,128,742.00	0.50
36	600196	复星医药	199,800	4,965,030.00	0.49
37	600004	白云机场	507,866	4,875,513.60	0.48
38	600332	白云山	166,100	4,720,562.00	0.46
39	601990	南京证券	534,300	4,627,038.00	0.45
40	688425	铁建重工	1,034,428	4,551,483.20	0.44
41	600688	上海石化	1,492,700	4,507,954.00	0.44
42	600905	三峡能源	948,700	4,145,819.00	0.41
43	600496	精工钢构	1,305,800	3,943,516.00	0.39
44	002448	中原内配	556,000	3,480,560.00	0.34
45	002863	今飞凯达	721,700	3,348,688.00	0.33
46	002788	鹭燕医药	407,800	3,348,038.00	0.33
47	000507	珠海港	653,500	3,332,850.00	0.33
48	002560	通达股份	482,000	3,287,240.00	0.32
49	002772	众兴菌业	438,200	3,229,534.00	0.32
50	601016	节能风电	1,011,200	3,205,504.00	0.31

51	002442	龙星化工	521,900	3,136,619.00	0.31
52	600351	亚宝药业	502,500	3,060,225.00	0.30
53	000726	鲁 泰 A	450,200	2,935,304.00	0.29
54	603987	康德莱	401,100	2,879,898.00	0.28
55	000089	深圳机场	414,000	2,852,460.00	0.28
56	002746	仙坛股份	449,700	2,851,098.00	0.28
57	600918	中泰证券	430,000	2,825,100.00	0.28
58	601678	滨化股份	746,000	2,804,960.00	0.27
59	001213	中铁特货	666,500	2,779,305.00	0.27
60	601877	正泰电器	116,900	2,736,629.00	0.27
61	600925	苏能股份	511,517	2,711,040.10	0.26
62	600011	华能国际	397,400	2,690,398.00	0.26
63	000554	泰山石油	432,500	2,569,050.00	0.25
64	002493	荣盛石化	277,100	2,507,755.00	0.25
65	603727	博迈科	211,869	2,432,256.12	0.24
66	600073	光明肉业	344,600	2,391,524.00	0.23
67	600512	腾达建设	994,700	2,357,439.00	0.23
68	002825	纳尔股份	300,500	2,349,910.00	0.23
69	002860	星帅尔	235,200	2,307,312.00	0.23
70	603681	永冠新材	177,900	2,293,131.00	0.22
71	603012	创力集团	427,200	2,268,432.00	0.22
72	600108	亚盛集团	742,400	2,175,232.00	0.21
73	300849	锦盛新材	153,700	2,159,485.00	0.21
74	605358	立昂微	85,900	2,127,743.00	0.21
75	000153	丰原药业	344,100	2,109,333.00	0.21
76	603391	力聚热能	50,000	2,104,500.00	0.21
77	002666	德联集团	474,800	2,070,128.00	0.20
78	601956	东贝集团	426,900	2,061,927.00	0.20
79	000407	胜利股份	595,000	2,034,900.00	0.20
80	002522	浙江众成	511,000	1,998,010.00	0.20
81	000728	国元证券	231,400	1,934,504.00	0.19
82	688078	龙软科技	72,590	1,902,583.90	0.19
83	603579	荣泰健康	130,430	1,891,235.00	0.18
84	600261	阳光照明	556,300	1,819,101.00	0.18
85	601228	广州港	533,300	1,807,887.00	0.18
86	688663	新风光	83,145	1,805,077.95	0.18
87	002768	国恩股份	77,800	1,794,846.00	0.18
88	600731	湖南海利	314,200	1,790,940.00	0.18
89	600713	南京医药	359,300	1,782,128.00	0.17
90	600897	厦门空港	115,100	1,752,973.00	0.17
91	000905	厦门港务	243,200	1,741,312.00	0.17
92	603886	元祖股份	120,400	1,736,168.00	0.17
93	688080	映翰通	52,005	1,712,004.60	0.17

94	000026	飞亚达	164,500	1,705,865.00	0.17
95	600359	新农开发	266,400	1,702,296.00	0.17
96	605166	聚合顺	140,500	1,681,785.00	0.16
97	603022	新通联	229,300	1,673,890.00	0.16
98	001277	速达股份	41,700	1,673,421.00	0.16
99	002726	龙大美食	208,100	1,648,152.00	0.16
100	002753	永东股份	258,700	1,622,049.00	0.16
101	601368	绿城水务	339,900	1,617,924.00	0.16
102	601007	金陵饭店	228,700	1,603,187.00	0.16
103	002206	海利得	371,800	1,595,022.00	0.16
104	002758	浙农股份	180,700	1,581,125.00	0.15
105	002328	新朋股份	252,600	1,548,438.00	0.15
106	002969	嘉美包装	493,300	1,534,163.00	0.15
107	603167	渤海轮渡	171,500	1,516,060.00	0.15
108	601008	连云港	395,200	1,513,616.00	0.15
109	601177	杭齿前进	182,800	1,513,584.00	0.15
110	603811	诚意药业	190,400	1,469,888.00	0.14
111	600681	百川能源	418,600	1,465,100.00	0.14
112	002393	力生制药	81,700	1,441,188.00	0.14
113	600218	全柴动力	182,000	1,437,800.00	0.14
114	603989	艾华集团	94,500	1,425,060.00	0.14
115	600379	宝光股份	143,600	1,359,892.00	0.13
116	002342	巨力索具	420,900	1,359,507.00	0.13
117	600265	景谷林业	74,500	1,303,750.00	0.13
118	300993	玉马科技	115,000	1,298,350.00	0.13
119	002627	三峡旅游	255,200	1,281,104.00	0.13
120	002144	宏达高科	122,400	1,274,184.00	0.12
121	603080	新疆火炬	77,600	1,247,808.00	0.12
122	002661	克明食品	124,000	1,247,440.00	0.12
123	000088	盐田港	250,100	1,217,987.00	0.12
124	300514	友讯达	83,600	1,207,184.00	0.12
125	600798	宁波海运	395,600	1,198,668.00	0.12
126	600495	晋西车轴	314,000	1,193,200.00	0.12
127	001226	拓山重工	43,400	1,186,990.00	0.12
128	600513	联环药业	119,200	1,181,272.00	0.12
129	603700	宁水集团	114,800	1,149,148.00	0.11
130	600330	天通股份	158,100	1,122,510.00	0.11
131	603817	海峡环保	200,400	1,118,232.00	0.11
132	002365	永安药业	137,700	1,100,223.00	0.11
133	002412	汉森制药	182,600	1,097,426.00	0.11
134	603115	海星股份	85,000	1,097,350.00	0.11
135	002441	众业达	138,700	1,079,086.00	0.11
136	002763	汇洁股份	161,400	1,071,696.00	0.10

137	301190	善水科技	67,000	1,057,930.00	0.10
138	002961	瑞达期货	73,100	1,050,447.00	0.10
139	603558	健盛集团	97,500	1,049,100.00	0.10
140	600596	新安股份	119,400	1,048,332.00	0.10
141	002394	联发股份	134,900	1,014,448.00	0.10
142	601718	际华集团	351,900	999,396.00	0.10
143	002228	合兴包装	332,600	997,800.00	0.10
144	605259	绿田机械	65,800	996,870.00	0.10
145	002688	金河生物	222,000	992,340.00	0.10
146	603856	东宏股份	88,800	981,240.00	0.10
147	600308	华泰股份	269,400	980,616.00	0.10
148	600051	宁波联合	149,500	977,730.00	0.10
149	002674	兴业科技	101,400	962,286.00	0.09
150	601886	江河集团	177,300	957,420.00	0.09
151	600063	皖维高新	235,400	941,600.00	0.09
152	002004	华邦健康	202,900	917,108.00	0.09
153	002732	燕塘乳业	57,300	900,183.00	0.09
154	300625	三雄极光	75,600	881,496.00	0.09
155	000825	太钢不锈	243,900	848,772.00	0.08
156	002391	长青股份	166,600	834,666.00	0.08
157	603321	梅轮电梯	118,700	830,900.00	0.08
158	300789	唐源电气	55,200	824,688.00	0.08
159	605189	富春染织	67,800	823,770.00	0.08
160	603165	荣晟环保	66,800	817,632.00	0.08
161	002191	劲嘉股份	192,200	807,240.00	0.08
162	603380	易德龙	31,400	784,686.00	0.08
163	002330	得利斯	178,000	777,860.00	0.08
164	600369	西南证券	165,800	774,286.00	0.08
165	601330	绿色动力	116,500	764,240.00	0.07
166	603966	法兰泰克	98,800	762,736.00	0.07
167	301015	百洋医药	31,200	755,352.00	0.07
168	603968	醋化股份	80,600	747,162.00	0.07
169	688330	宏力达	28,467	746,974.08	0.07
170	688558	国盛智科	34,653	739,841.55	0.07
171	002566	益盛药业	107,800	735,196.00	0.07
172	600477	杭萧钢构	283,000	727,310.00	0.07
173	001218	丽臣实业	42,000	723,660.00	0.07
174	002135	东南网架	169,600	720,800.00	0.07
175	688579	山大地纬	78,061	717,380.59	0.07
176	301265	华新环保	80,000	716,800.00	0.07
177	000570	苏常柴 A	139,900	712,091.00	0.07
178	000920	沃顿科技	73,700	657,404.00	0.06
179	300048	合康新能	129,800	654,192.00	0.06

180	301276	嘉曼服饰	32,100	653,235.00	0.06
181	688571	杭华股份	97,277	652,728.67	0.06
182	603639	海利尔	52,600	652,240.00	0.06
183	001333	光华股份	37,600	650,856.00	0.06
184	300095	华伍股份	95,800	650,482.00	0.06
185	605500	森林包装	93,423	650,224.08	0.06
186	001225	和泰机电	20,000	646,400.00	0.06
187	688269	凯立新材	25,760	643,484.80	0.06
188	600516	方大炭素	132,800	641,424.00	0.06
189	301196	唯科科技	19,500	640,965.00	0.06
190	688722	同益中	46,962	598,765.50	0.06
191	600980	北矿科技	39,100	597,448.00	0.06
192	688308	欧科亿	32,722	590,632.10	0.06
193	603836	海程邦达	48,500	589,760.00	0.06
194	603689	皖天然气	65,100	584,598.00	0.06
195	688519	南亚新材	27,377	582,035.02	0.06
196	002942	新农股份	41,000	578,920.00	0.06
197	603180	金牌家居	27,300	573,573.00	0.06
198	603137	恒尚节能	53,900	571,340.00	0.06
199	002136	安纳达	57,600	561,600.00	0.05
200	603041	美思德	51,400	549,466.00	0.05
201	300834	星辉环材	27,800	549,328.00	0.05
202	688199	久日新材	36,013	541,995.65	0.05
203	301303	真兰仪表	35,100	537,732.00	0.05
204	688133	泰坦科技	27,623	503,843.52	0.05
205	688317	之江生物	29,995	487,418.75	0.05
206	688238	和元生物	97,662	482,450.28	0.05
207	301108	洁雅股份	18,600	478,950.00	0.05
208	601568	北元集团	114,000	478,800.00	0.05
209	605058	澳弘电子	24,000	475,920.00	0.05
210	600061	国投资本	62,500	470,000.00	0.05
211	301290	东星医疗	19,700	457,828.00	0.04
212	301319	唯特偶	15,700	457,812.00	0.04
213	603105	芯能科技	50,800	457,708.00	0.04
214	600668	尖峰集团	44,700	453,705.00	0.04
215	300837	浙矿股份	22,400	451,584.00	0.04
216	603601	再升科技	134,000	450,240.00	0.04
217	603982	泉峰汽车	53,800	428,248.00	0.04
218	300767	震安科技	45,700	412,214.00	0.04
219	688135	利扬芯片	20,027	401,941.89	0.04
220	002300	太阳电缆	73,200	390,888.00	0.04
221	600874	创业环保	65,300	389,841.00	0.04
222	000731	四川美丰	52,900	388,286.00	0.04

223	603113	金能科技	68,100	383,403.00	0.04
224	603916	苏博特	50,800	378,968.00	0.04
225	603187	海容冷链	33,700	377,103.00	0.04
226	301115	建科股份	26,800	374,932.00	0.04
227	605288	凯迪股份	10,900	370,273.00	0.04
228	688689	银河微电	17,251	365,548.69	0.04
229	688291	金橙子	18,942	364,065.24	0.04
230	300230	永利股份	81,000	360,450.00	0.04
231	601218	吉鑫科技	110,300	359,578.00	0.04
232	300259	新天科技	102,200	357,700.00	0.03
233	300055	万邦达	74,400	356,376.00	0.03
234	603177	德创环保	47,600	350,336.00	0.03
235	000055	方大集团	86,600	341,204.00	0.03
236	603136	天目湖	29,100	328,830.00	0.03
237	300983	尤安设计	17,700	299,307.00	0.03
238	605068	明新旭腾	21,900	294,555.00	0.03
239	600573	惠泉啤酒	26,100	293,886.00	0.03
240	603208	江山欧派	15,700	288,880.00	0.03
241	300452	山河药辅	23,700	287,007.00	0.03
242	301331	恩威医药	12,400	286,440.00	0.03
243	301003	江苏博云	13,100	285,973.00	0.03
244	000601	韶能股份	70,400	285,824.00	0.03
245	001316	润贝航科	9,800	284,200.00	0.03
246	300485	赛升药业	40,100	281,101.00	0.03
247	603757	大元泵业	14,000	280,700.00	0.03
248	300258	精锻科技	31,500	280,665.00	0.03
249	688061	灿瑞科技	9,650	278,692.00	0.03
250	688170	德龙激光	12,318	277,031.82	0.03
251	600643	爱建集团	53,500	276,595.00	0.03
252	002454	松芝股份	41,500	275,975.00	0.03
253	301192	泰祥股份	15,800	275,078.00	0.03
254	603089	正裕工业	30,500	273,585.00	0.03
255	688468	科美诊断	39,772	272,438.20	0.03
256	688529	豪森智能	17,082	268,016.58	0.03
257	001230	劲旅环境	15,500	256,990.00	0.03
258	605003	众望布艺	13,500	255,150.00	0.02
259	300513	恒实科技	27,700	252,901.00	0.02
260	600116	三峡水利	36,000	251,640.00	0.02
261	300996	普联软件	13,800	250,056.00	0.02
262	688148	芳源股份	48,731	241,218.45	0.02
263	603538	美诺华	18,900	240,219.00	0.02
264	301046	能辉科技	11,000	220,660.00	0.02
265	600222	太龙药业	39,200	199,528.00	0.02

266	688285	高铁电气	26,510	196,174.00	0.02
267	603017	中衡设计	23,800	191,114.00	0.02
268	603367	辰欣药业	13,900	190,986.00	0.02
269	688786	悦安新材	7,752	190,931.76	0.02
270	603150	万朗磁塑	7,200	190,872.00	0.02
271	301395	仁信新材	17,200	190,232.00	0.02
272	688386	泛亚微透	6,292	190,144.24	0.02
273	603926	铁流股份	21,200	187,620.00	0.02
274	688257	新锐股份	10,238	186,433.98	0.02
275	603618	杭电股份	34,200	185,706.00	0.02
276	688129	东来技术	10,946	184,768.48	0.02
277	688184	帕瓦股份	13,457	184,495.47	0.02
278	688657	浩辰软件	4,634	183,784.44	0.02
279	002363	隆基机械	27,900	183,303.00	0.02
280	688479	友车科技	10,295	182,736.25	0.02
281	688395	正弦电气	10,732	182,336.68	0.02
282	002623	亚玛顿	11,800	182,074.00	0.02
283	600526	菲达环保	40,500	181,845.00	0.02
284	688280	精进电动	41,270	181,175.30	0.02
285	300653	正海生物	8,500	181,050.00	0.02
286	300110	华仁药业	51,400	180,928.00	0.02
287	300575	中旗股份	29,800	180,886.00	0.02
288	300821	东岳硅材	23,300	180,808.00	0.02
289	603506	南都物业	21,200	180,412.00	0.02
290	300636	同和药业	22,400	178,528.00	0.02
291	300358	楚天科技	25,900	177,674.00	0.02
292	002852	道道全	21,400	176,764.00	0.02
293	300774	倍杰特	19,400	170,332.00	0.02
294	300800	力合科技	16,300	170,009.00	0.02
295	600938	中国海油	5,700	168,207.00	0.02
296	300051	璩升科技	24,400	163,236.00	0.02
297	603396	金辰股份	6,000	161,400.00	0.02
298	688292	浩瀚深度	7,889	156,202.20	0.02
299	603928	兴业股份	18,700	154,836.00	0.02
300	300439	美康生物	13,600	142,120.00	0.01
301	300864	南大环境	5,600	117,432.00	0.01
302	688334	西高院	6,868	112,154.44	0.01
303	301203	国泰环保	3,200	96,768.00	0.01
304	688370	丛麟科技	4,917	96,520.71	0.01
305	301468	博盈特焊	4,600	96,508.00	0.01
306	600459	贵研铂业	7,000	96,110.00	0.01
307	301216	万凯新材	9,400	95,880.00	0.01
308	300867	圣元环保	7,400	95,682.00	0.01

309	002014	永新股份	8,600	94,256.00	0.01
310	603331	百达精工	10,400	93,704.00	0.01
311	688768	容知日新	2,567	93,284.78	0.01
312	688179	阿拉丁	6,705	92,529.00	0.01
313	688231	隆达股份	6,501	92,444.22	0.01
314	688057	金达莱	8,280	91,908.00	0.01
315	301309	万得凯	3,800	91,846.00	0.01
316	301373	凌玮科技	3,600	91,368.00	0.01
317	688098	申联生物	16,663	91,146.61	0.01
318	605033	美邦股份	7,500	90,225.00	0.01
319	002234	民和股份	10,100	89,789.00	0.01
320	688580	伟思医疗	3,216	89,758.56	0.01
321	603938	三孚股份	8,300	89,723.00	0.01
322	688211	中科微至	3,059	89,475.75	0.01
323	002492	恒基达鑫	18,400	88,504.00	0.01
324	688357	建龙微纳	4,024	88,246.32	0.01
325	601279	英利汽车	22,900	87,707.00	0.01
326	603787	新日股份	7,700	80,234.00	0.01
327	301103	何氏眼科	3,900	78,468.00	0.01
328	600423	柳化股份	26,300	77,322.00	0.01
329	605303	园林股份	9,500	72,010.00	0.01
330	688592	司南导航	200	7,480.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	186,849,679.60	11.09
2	000651	格力电器	178,989,121.04	10.63
3	600941	中国移动	177,040,015.48	10.51
4	000858	五 粮 液	166,197,481.09	9.87
5	600900	长江电力	160,327,552.50	9.52
6	000333	美的集团	155,478,585.04	9.23
7	601288	农业银行	134,665,932.00	7.99
8	600028	中国石化	130,519,491.50	7.75
9	600519	贵州茅台	127,498,548.58	7.57
10	601328	交通银行	121,464,938.71	7.21
11	601398	工商银行	111,793,262.00	6.64
12	300760	迈瑞医疗	111,651,115.63	6.63
13	601688	华泰证券	109,774,858.90	6.52
14	000338	潍柴动力	104,656,583.28	6.21
15	601006	大秦铁路	104,636,100.00	6.21
16	600030	中信证券	97,204,586.76	5.77

17	601211	国泰君安	95,487,199.00	5.67
18	600919	江苏银行	94,708,264.79	5.62
19	600887	伊利股份	94,545,808.75	5.61
20	601658	邮储银行	89,958,799.00	5.34
21	601319	中国人保	88,492,175.00	5.25
22	003816	中国广核	87,130,130.80	5.17
23	601888	中国中免	85,872,304.00	5.10
24	601169	北京银行	85,052,341.48	5.05
25	002415	海康威视	84,153,256.90	5.00
26	601668	中国建筑	83,624,239.00	4.96
27	600036	招商银行	83,305,096.00	4.95
28	601229	上海银行	81,281,880.73	4.83
29	601009	南京银行	80,924,228.87	4.80
30	601939	建设银行	80,824,517.00	4.80
31	600016	民生银行	78,672,898.00	4.67
32	000568	泸州老窖	77,947,631.40	4.63
33	601818	光大银行	77,749,149.00	4.62
34	600050	中国联通	77,456,025.00	4.60
35	601877	正泰电器	75,380,860.14	4.47
36	600809	山西汾酒	75,155,296.40	4.46
37	600183	生益科技	74,373,234.13	4.42
38	300014	亿纬锂能	74,170,128.35	4.40
39	600000	浦发银行	74,103,129.50	4.40
40	600015	华夏银行	73,438,180.19	4.36
41	600104	上汽集团	72,460,091.00	4.30
42	601728	中国电信	72,079,057.00	4.28
43	601669	中国电建	70,141,679.00	4.16
44	603501	韦尔股份	69,854,935.94	4.15
45	601012	隆基绿能	69,143,644.64	4.10
46	601919	中远海控	65,864,060.93	3.91
47	000166	申万宏源	65,757,131.43	3.90
48	002241	歌尔股份	65,032,631.00	3.86
49	000725	京东方 A	62,057,328.00	3.68
50	601898	中煤能源	60,744,326.00	3.61
51	601601	中国太保	59,574,952.12	3.54
52	600309	万华化学	58,320,311.26	3.46
53	600588	用友网络	58,071,690.00	3.45
54	000021	深科技	57,781,326.03	3.43
55	600460	士兰微	57,284,240.00	3.40
56	600219	南山铝业	56,671,268.00	3.36
57	600745	闻泰科技	56,303,559.00	3.34
58	600989	宝丰能源	55,102,376.92	3.27
59	600999	招商证券	54,440,690.80	3.23

60	600346	恒力石化	52,330,788.13	3.11
61	000895	双汇发展	52,042,926.00	3.09
62	603160	汇顶科技	51,598,836.08	3.06
63	600926	杭州银行	50,944,613.00	3.02
64	601336	新华保险	50,642,681.00	3.01
65	601166	兴业银行	50,381,387.00	2.99
66	601988	中国银行	50,220,396.00	2.98
67	300750	宁德时代	49,726,806.67	2.95
68	600019	宝钢股份	49,132,026.00	2.92
69	300207	欣旺达	48,957,598.46	2.91
70	600886	国投电力	48,840,636.97	2.90
71	600674	川投能源	48,280,086.00	2.87
72	600905	三峡能源	48,271,420.00	2.87
73	002410	广联达	48,150,070.20	2.86
74	600188	兖矿能源	47,472,990.14	2.82
75	601857	中国石油	47,175,424.00	2.80
76	600100	同方股份	46,738,094.22	2.77
77	600585	海螺水泥	46,712,673.00	2.77
78	600018	上港集团	46,344,383.00	2.75
79	601998	中信银行	45,875,618.00	2.72
80	601868	中国能建	45,823,615.89	2.72
81	600025	华能水电	44,451,844.03	2.64
82	601865	福莱特	43,734,352.59	2.60
83	600690	海尔智家	43,224,111.00	2.57
84	300999	金龙鱼	43,219,583.00	2.57
85	300433	蓝思科技	41,890,726.28	2.49
86	600332	白云山	41,702,139.00	2.48
87	600436	片仔癀	41,315,954.91	2.45
88	600031	三一重工	41,238,576.00	2.45
89	000066	中国长城	40,684,731.77	2.42
90	300474	景嘉微	40,031,684.73	2.38
91	601916	浙商银行	39,716,766.00	2.36
92	002074	国轩高科	39,434,286.00	2.34
93	601377	兴业证券	39,239,283.80	2.33
94	601238	广汽集团	39,027,207.46	2.32
95	600699	均胜电子	38,606,610.19	2.29
96	600276	恒瑞医药	38,148,260.33	2.26
97	002152	广电运通	37,899,219.75	2.25
98	601816	京沪高铁	37,660,144.68	2.24
99	603288	海天味业	37,488,379.15	2.23
100	002352	顺丰控股	36,336,995.40	2.16
101	601216	君正集团	36,141,554.00	2.15
102	600707	彩虹股份	35,652,927.00	2.12

103	601231	环旭电子	34,937,918.58	2.07
104	600893	航发动力	34,766,467.40	2.06
105	601088	中国神华	34,714,595.00	2.06
106	000538	云南白药	34,677,986.60	2.06
107	600741	华域汽车	33,805,371.77	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	186,336,519.14	11.06
2	600900	长江电力	164,846,118.10	9.79
3	000333	美的集团	157,498,427.91	9.35
4	600941	中国移动	157,436,901.20	9.35
5	000651	格力电器	149,514,299.82	8.88
6	000858	五粮液	139,538,836.71	8.28
7	601288	农业银行	137,771,619.00	8.18
8	600028	中国石化	132,624,174.90	7.87
9	601319	中国人保	123,813,142.25	7.35
10	601328	交通银行	119,523,675.24	7.10
11	601398	工商银行	115,148,833.00	6.84
12	300760	迈瑞医疗	108,075,964.63	6.42
13	600030	中信证券	99,152,132.87	5.89
14	600519	贵州茅台	96,802,435.76	5.75
15	601688	华泰证券	96,555,768.80	5.73
16	002241	歌尔股份	95,287,973.50	5.66
17	601211	国泰君安	94,299,019.00	5.60
18	601658	邮储银行	91,513,829.99	5.43
19	601668	中国建筑	88,613,795.20	5.26
20	003816	中国广核	87,942,911.08	5.22
21	600036	招商银行	84,387,016.00	5.01
22	601169	北京银行	83,831,541.87	4.98
23	601229	上海银行	83,728,402.69	4.97
24	601939	建设银行	81,792,675.85	4.86
25	600809	山西汾酒	80,554,419.00	4.78
26	000568	泸州老窖	78,052,302.22	4.63
27	600050	中国联通	78,029,926.00	4.63
28	601818	光大银行	77,016,948.00	4.57
29	600016	民生银行	76,497,597.23	4.54
30	600000	浦发银行	76,343,301.62	4.53
31	601728	中国电信	75,112,973.00	4.46
32	300433	蓝思科技	74,584,678.17	4.43
33	600183	生益科技	73,603,516.38	4.37

34	600745	闻泰科技	72,758,526.56	4.32
35	601877	正泰电器	72,589,856.96	4.31
36	601006	大秦铁路	72,530,333.00	4.31
37	600104	上汽集团	72,215,157.92	4.29
38	000338	潍柴动力	72,090,097.94	4.28
39	603501	韦尔股份	71,000,564.80	4.21
40	600919	江苏银行	70,888,378.68	4.21
41	300014	亿纬锂能	69,688,436.00	4.14
42	600887	伊利股份	68,180,507.00	4.05
43	601919	中远海控	67,968,831.53	4.03
44	002415	海康威视	66,779,899.36	3.96
45	002410	广联达	64,452,472.40	3.83
46	600588	用友网络	62,067,073.00	3.68
47	601009	南京银行	61,645,496.38	3.66
48	601888	中国中免	60,529,906.52	3.59
49	000021	深科技	60,453,339.48	3.59
50	601898	中煤能源	60,212,336.00	3.57
51	601601	中国太保	59,496,597.16	3.53
52	000166	申万宏源	58,837,900.20	3.49
53	600460	士兰微	57,889,661.31	3.44
54	601012	隆基绿能	57,172,626.24	3.39
55	600219	南山铝业	56,046,732.80	3.33
56	600989	宝丰能源	55,705,691.34	3.31
57	601857	中国石油	54,871,138.38	3.26
58	300454	深信服	54,771,270.80	3.25
59	600999	招商证券	54,123,398.00	3.21
60	600015	华夏银行	53,821,762.28	3.20
61	300207	欣旺达	53,746,643.32	3.19
62	603160	汇顶科技	52,251,465.76	3.10
63	601988	中国银行	52,143,138.00	3.10
64	600100	同方股份	51,177,782.95	3.04
65	601166	兴业银行	50,118,795.00	2.98
66	600886	国投电力	49,894,920.84	2.96
67	601336	新华保险	49,171,406.00	2.92
68	600019	宝钢股份	49,118,890.00	2.92
69	300750	宁德时代	48,887,747.20	2.90
70	300474	景嘉微	48,717,950.48	2.89
71	600018	上港集团	48,539,777.00	2.88
72	600674	川投能源	47,666,746.96	2.83
73	601998	中信银行	47,500,177.23	2.82
74	300999	金龙鱼	47,443,623.76	2.82
75	600585	海螺水泥	46,868,927.00	2.78
76	600926	杭州银行	45,057,608.20	2.67

77	002384	东山精密	44,351,330.40	2.63
78	000895	双汇发展	44,224,403.50	2.63
79	600025	华能水电	44,134,028.00	2.62
80	002074	国轩高科	43,478,865.58	2.58
81	600905	三峡能源	42,438,418.00	2.52
82	688538	和辉光电	42,144,528.66	2.50
83	601916	浙商银行	40,749,534.00	2.42
84	600690	海尔智家	40,561,701.45	2.41
85	601669	中国电建	40,473,754.00	2.40
86	600031	三一重工	40,400,998.00	2.40
87	000066	中国长城	40,053,718.62	2.38
88	603288	海天味业	39,845,054.43	2.37
89	601865	福莱特	39,594,630.92	2.35
90	600346	恒力石化	39,295,660.01	2.33
91	601816	京沪高铁	39,041,483.76	2.32
92	601238	广汽集团	38,535,278.84	2.29
93	603919	金徽酒	38,511,130.00	2.29
94	600707	彩虹股份	38,418,867.00	2.28
95	601216	君正集团	37,772,477.00	2.24
96	600332	白云山	37,733,397.10	2.24
97	002152	广电运通	37,654,589.38	2.24
98	601088	中国神华	37,331,899.50	2.22
99	002185	华天科技	37,315,405.74	2.22
100	002916	深南电路	37,070,181.64	2.20
101	600276	恒瑞医药	36,974,855.01	2.19
102	600570	恒生电子	36,924,609.00	2.19
103	002600	领益智造	36,828,589.00	2.19
104	600699	均胜电子	36,662,814.88	2.18
105	002352	顺丰控股	36,306,751.35	2.16
106	603799	华友钴业	36,090,422.41	2.14
107	600436	片仔癀	35,764,618.20	2.12
108	600188	兖矿能源	35,505,427.08	2.11
109	300136	信维通信	35,330,920.58	2.10
110	600309	万华化学	35,159,118.78	2.09
111	601231	环旭电子	34,991,435.94	2.08
112	000538	云南白药	34,887,453.20	2.07
113	000725	京东方 A	34,875,165.00	2.07
114	002475	立讯精密	34,808,794.66	2.07
115	600879	航天电子	34,770,473.00	2.06
116	002558	巨人网络	33,734,958.06	2.00
117	600893	航发动力	33,734,294.08	2.00

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

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	15,237,850,149.59
卖出股票收入（成交）总额	15,883,397,507.26

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,215.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,215.37

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 (%)
国金智享 量化选股 混合 A	5,364	86,815.50	2,330,171.42	0.50	463,348,174.68	99.50
国金智享 量化选股 混合 C	14,310	41,956.36	2,249,352.09	0.37	598,146,226.16	99.63
合计	19,674	54,186.94	4,579,523.51	0.43	1,061,494,400.84	99.57

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	国金智享量化选股混合 A	10,159.01	0.0022
	国金智享量化选股混合 C	61,597.38	0.0103

人员持有本基金			
	合计	71,756.39	0.0067

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金智享量化选股混合 A	0
	国金智享量化选股混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国金智享量化选股混合 A	0
	国金智享量化选股混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
基金合同生效日 （2023 年 8 月 22 日） 基金份额总额	847,202,079.90	1,144,845,934.37
本报告期期初基金份额总额	780,456,800.53	1,013,329,690.13
本报告期基金总申购份额	53,117,506.95	63,427,328.22
减：本报告期基金总赎回份额	367,895,961.38	476,361,440.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	465,678,346.10	600,395,578.25

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

原督察长张静女士自 2024 年 11 月 20 日起由于个人原因离任基金管理人督察长职务，虞志海先生自 2024 年 11 月 20 日起担任基金管理人督察长职务。

除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 85,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
广发证券	2	31,121,247,656.85	100.00	15,056,608.38	100.00	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	-	-	388,091,000.00	100.00	-	-

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	2024 年 01 月 11 日
2	《国金基金管理有限公司关于本公司办公地址变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 01 月 19 日
3	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 01 月 20 日
4	《国金智享量化选股混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 02 月 06 日
5	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 A 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	2024 年 02 月 06 日
6	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 C 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	2024 年 02 月 06 日
7	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2023 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 03 月 29 日
8	《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	2024 年 04 月 16 日
9	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 04 月 20 日
10	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 04 月 30 日

11	《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	2024 年 05 月 23 日
12	《国金基金管理有限公司旗下基金调整股票估值方法的提示性公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 06 月 22 日
13	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 A 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	2024 年 06 月 25 日
14	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 C 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	2024 年 06 月 25 日
15	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 07 月 19 日
16	《国金基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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	2024 年 08 月 29 日
17	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年中期报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 08 月 31 日
18	《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	2024 年 10 月 17 日
19	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
20	《国金基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 11 月 05 日
21	《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	2024 年 11 月 14 日
22	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 11 月 21 日
23	《国金基金管理有限公司关于本公司住所变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 11 月 23 日
24	《国金基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售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	2024 年 12 月 20 日
25	《国金基金管理有限公司关于关闭微信交易平台开户、认购、申购（含定期定额投资）、转换业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 年 12 月 27 日
26	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2024 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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金智享量化选股混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金智享量化选股混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金智享量化选股混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日