

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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 主要财务指标和基金净值表现	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
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化多策略	
基金主代码	005443	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,348,036,075.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
下属分级基金的交易代码	005443	017874
报告期末下属分级基金的份额总额	717,169,899.93 份	630,866,175.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、量化选股模型、债券投资策略、资产支持证券投资策略、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	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

注：自 2024 年 1 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张静	石立平
	联系电话	010-88005695	010-63639180
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100020	100033
法定代表人		邰海波	吴利军

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
本期已实现收益	-109,988,074.84	-58,063,688.38
本期利润	-29,378,971.93	-29,592,866.74
加权平均基金份 额本期利润	-0.0164	-0.0221
本期加权平均净 值利润率	-1.52%	-2.06%
本期基金份额净 值增长率	-5.35%	-5.53%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	46,928,190.90	37,839,473.13
期末可供分配基金份额利润	0.0654	0.0600
期末基金资产净值	764,098,090.83	668,705,648.69
期末基金份额净值	1.0654	1.0600
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	15.47%	-11.13%

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

国金量化多策略 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.31%	0.54%	-2.46%	0.38%	0.15%	0.16%
过去三个月	-1.84%	0.75%	-1.31%	0.60%	-0.53%	0.15%
过去六个月	-5.35%	1.32%	-0.93%	0.75%	-4.42%	0.57%
过去一年	-9.94%	1.07%	-5.77%	0.64%	-4.17%	0.43%
过去三年	7.23%	1.10%	-8.53%	0.67%	15.76%	0.43%
自基金合同生效起至今	15.47%	1.11%	8.10%	0.74%	7.37%	0.37%

国金量化多策略 C

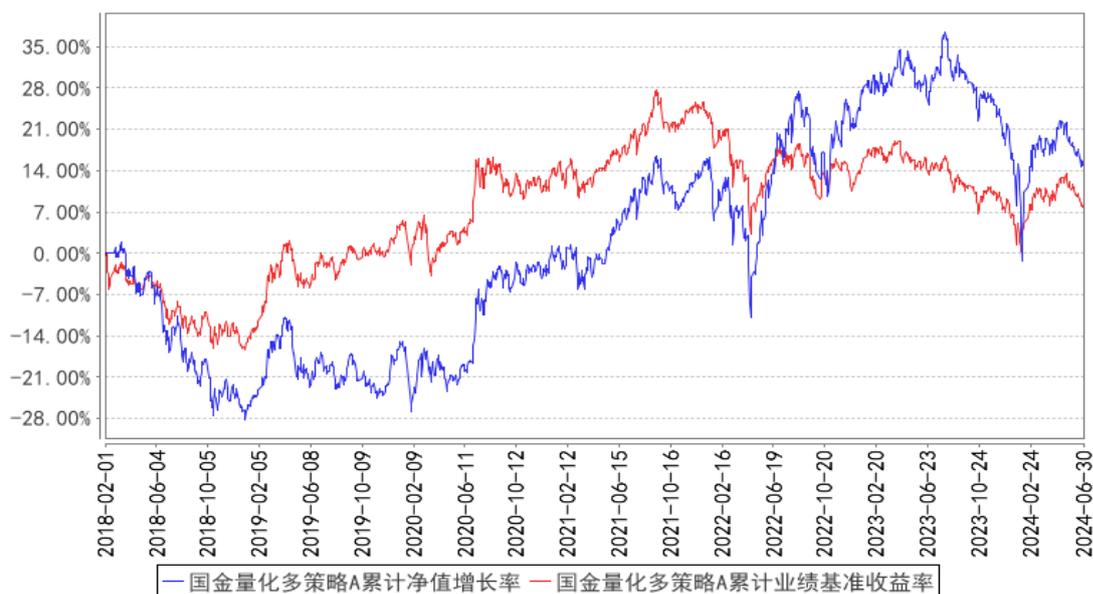
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	-2.34%	0.54%	-2.46%	0.38%	0.12%	0.16%
过去三个月	-1.93%	0.75%	-1.31%	0.60%	-0.62%	0.15%
过去六个月	-5.53%	1.32%	-0.93%	0.75%	-4.60%	0.57%
过去一年	-10.29%	1.07%	-5.77%	0.64%	-4.52%	0.43%
自基金合同生效起至今	-11.13%	0.98%	-8.20%	0.60%	-2.93%	0.38%

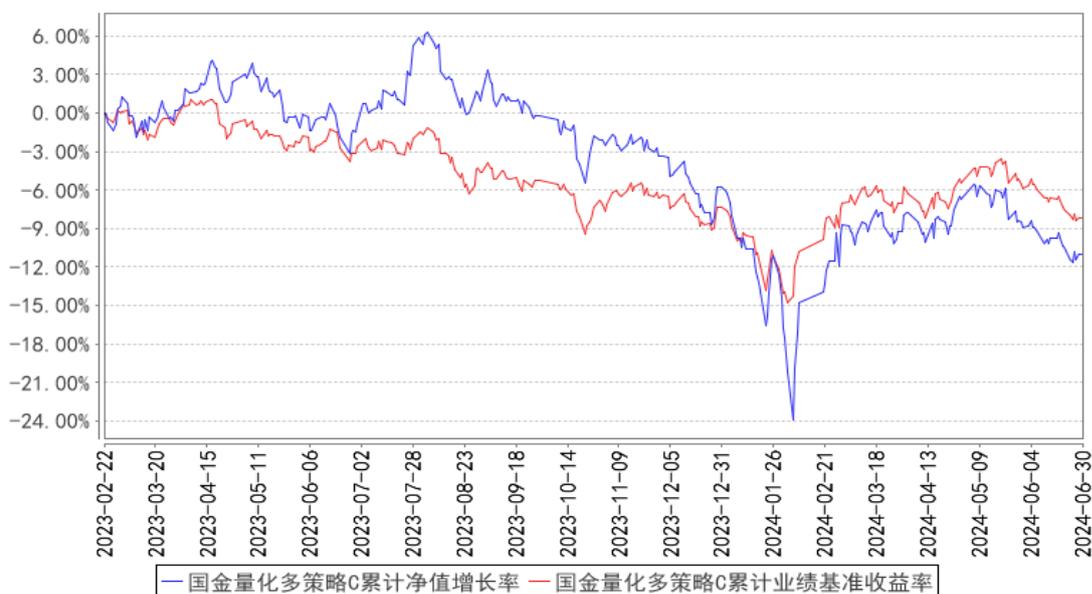
注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”；自 2024 年 1 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

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

国金量化多策略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



国金量化多策略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 2 月 1 日，图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2023 年 2 月 22 日，图示日期为 2023 年 2 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2024 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 26 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。

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	-	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。
姚加红	本基金的基金经理	2023 年 1 月 5 日	-	20 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	2	5,234,622,000.60	2023 年 01 月 05 日
	私募资产管理计划	5	771,838,063.18	2016 年 04 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	6,006,460,063.78	-

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。

4.2 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《国金量化多策略灵活配置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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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

报告期内，市场环境方面：2024 年 2 月前后的波动为近十年高点，后续虽有所降低，4 月和 5 月的波动水平仍处于历史较高位置。市场活跃度呈现持续下降的趋势，处于 2019 年以来的较低水平位置。具体因子方面：报告期内动量因子收益持续性较强，市值类和残差波动等因子波动性较大、持续性较弱。行业涨跌方面：大部分行业在报告期内录得负收益，其中涨幅高于 10% 的行业为银行、煤炭、石油石化和家电等，综合、消费者服务和计算机等行业跌幅较大，最大跌幅超过 37%。

报告期内，本基金的风险收益特征较业绩比较基准呈现一定的波动性，并持续适应市场风格

的变化。国金量化策略收益来源多样化、持仓分散度较高，风险模型的优化一定程度上或利于相对收益波动的降低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 1.0654 元，累计单位净值为 1.1596 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-5.35%，同期业绩比较基准增长率为-0.93%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.0600 元，累计单位净值为 1.0600 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-5.53%，同期业绩比较基准增长率为-0.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场环境下，伴随市场活跃度较低的特征，市场风格的切换或较为频繁。但基于历史数据，较大范围偏离均值的情况其均值回归的动力亦较强。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2024年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产:			
货币资金	6.4.7.1	156,237,141.96	378,230,571.10

结算备付金		0.06	0.06
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,321,915,801.46	3,785,432,870.94
其中：股票投资		1,321,915,801.46	3,785,432,870.94
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,076,505.86	2,113,880.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,481,229,449.34	4,165,777,322.22
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,277.90	-
应付赎回款		45,944,176.17	90,887,902.91
应付管理人报酬		1,740,169.92	4,163,042.29
应付托管费		290,028.32	693,840.37
应付销售服务费		231,894.77	718,838.26
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	211,162.74	257,735.41
负债合计		48,425,709.82	96,721,359.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,348,036,075.49	3,620,441,699.60
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	84,767,664.03	448,614,263.38
净资产合计		1,432,803,739.52	4,069,055,962.98
负债和净资产总计		1,481,229,449.34	4,165,777,322.22

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国金量化多策略 A 基金份额净值 1.0654 元，基金份额总额 717,169,899.93 份；国金量化多策略 C 基金份额净值 1.0600 元，基金份额总额 630,866,175.56 份。国金量化多策略份额总额合计为 1,348,036,075.49 份。

6.2 利润表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-32,232,691.26	15,960,906.08
1. 利息收入		783,214.36	309,247.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	691,649.72	307,688.64
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		91,564.64	1,559.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-152,348,319.09	57,967,803.14
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-169,263,936.90	35,918,916.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	16,915,617.81	22,048,887.02
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	109,079,924.55	-44,417,410.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	10,252,488.92	2,101,265.92
减：二、营业总支出		26,739,147.41	10,745,996.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,356,588.09	8,711,759.13
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,392,764.75	1,451,959.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,880,396.19	493,016.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	109,398.38	89,260.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-58,971,838.67	5,214,910.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-58,971,838.67	5,214,910.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-58,971,838.67	5,214,910.06

6.3 净资产变动表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,620,441,699.60	-	448,614,263.38	4,069,055,962.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,620,441,699.60	-	448,614,263.38	4,069,055,962.98
三、本期增减变动额(减少以“-”	-	-	-	-

号填列)	2, 272, 405, 624. 11		363, 846, 599. 35	2, 636, 252, 223. 4 6
(一)、综合收益总额	-	-	-58, 971, 838. 67	-58, 971, 838. 67
(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)	- 2, 272, 405, 624. 11	-	- 304, 874, 760. 68	- 2, 577, 280, 384. 7 9
其中：1. 基金申购款	2, 591, 404, 271. 53	-	36, 009, 582. 62	2, 627, 413, 854. 1 5
2. 基金赎回款	- 4, 863, 809, 895. 64	-	- 340, 884, 343. 30	- 5, 204, 694, 238. 9 4
(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, 348, 036, 075. 49	-	84, 767, 664. 03	1, 432, 803, 739. 5 2
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	489, 728, 052. 73	-	60, 784, 783. 11	550, 512, 835. 84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	489, 728, 052. 73	-	60, 784, 783. 11	550, 512, 835. 84
三、本期增减变动额(减少以“-”	1, 272, 729, 132.	-	260, 939, 508. 29	1, 533, 668, 640. 5

号填列)	29			8
(一)、综合收益总额	-	-	5,214,910.06	5,214,910.06
(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)	1,272,729,132.29	-	255,724,598.23	1,528,453,730.52
其中：1. 基金申购款	1,872,584,585.40	-	367,259,524.98	2,239,844,110.38
2. 基金赎回款	-599,855,453.11	-	-111,534,926.75	-711,390,379.86
(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	1,762,457,185.02	-	321,724,291.40	2,084,181,476.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邰海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1615 号文《关于准予国金量化多策略灵活配置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 2018 年 2 月 1 日生效，本基金首次募集规模为 425,485,490.92 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股

份有限公司。

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《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于 2023 年 2 月 22 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批准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人

为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,205,505.10
等于：本金	2,201,932.01
加：应计利息	3,573.09
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	154,031,636.86
等于：本金	154,018,307.79
加：应计利息	13,329.07
减：坏账准备	-
合计	156,237,141.96

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,389,452,916.53	-	1,321,915,801.46	-67,537,115.07
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		1,389,452,916.53	-	1,321,915,801.46	-67,537,115.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	98,086.36
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	109,398.38
其他	3,678.00
合计	211,162.74

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化多策略 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,939,656,883.42	1,939,656,883.42
本期申购	1,697,101,965.85	1,697,101,965.85
本期赎回（以“-”号填列）	-2,919,588,949.34	-2,919,588,949.34
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	717,169,899.93	717,169,899.93

国金量化多策略 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,680,784,816.18	1,680,784,816.18

本期申购	894,302,305.68	894,302,305.68
本期赎回(以“-”号填列)	-1,944,220,946.30	-1,944,220,946.30
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	630,866,175.56	630,866,175.56

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

6.4.7.11 其他综合收益

注：无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金量化多策略 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	258,759,496.68	-15,226,751.04	243,532,745.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	258,759,496.68	-15,226,751.04	243,532,745.64
本期利润	-109,988,074.84	80,609,102.91	-29,378,971.93
本期基金份额交易产生的变动数	-84,839,679.72	-82,385,903.09	-167,225,582.81
其中：基金申购款	149,603,993.80	-117,373,580.94	32,230,412.86
基金赎回款	-234,443,673.52	34,987,677.85	-199,455,995.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,931,742.12	-17,003,551.22	46,928,190.90

国金量化多策略 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	309,766,533.26	-104,685,015.52	205,081,517.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	309,766,533.26	-104,685,015.52	205,081,517.74
本期利润	-58,063,688.38	28,470,821.64	-29,592,866.74
本期基金份额交易产生的变动数	-164,614,121.57	26,964,943.70	-137,649,177.87
其中：基金申购款	119,356,638.23	-115,577,468.47	3,779,169.76
基金赎回款	-283,970,759.80	142,542,412.17	-141,428,347.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,088,723.31	-49,249,250.18	37,839,473.13

6.4.7.13 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6月30日
活期存款利息收入	233,797.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	457,851.89
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	691,649.72

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-169,263,936.90
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	-169,263,936.90

6.4.7.14.2 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6月30日
卖出股票成交总额	16,562,678,103.41
减：卖出股票成本总额	16,705,405,603.79
减：交易费用	26,536,436.52
买卖股票差价收入	-169,263,936.90

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	16,915,617.81
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	16,915,617.81

6.4.7.20 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6月30日
1. 交易性金融资产	109,079,924.55
股票投资	109,079,924.55
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	109,079,924.55

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	9,884,750.14
基金转换费收入	367,738.78
合计	10,252,488.92

6.4.7.22 信用减值损失

注：无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	109,398.38

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,356,588.09	8,711,759.13

其中：应支付销售机构的客户维护费	3,546,380.06	1,572,243.48
应支付基金管理人的净管理费	16,810,208.03	7,139,515.65

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基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,392,764.75	1,451,959.86

注：1. 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。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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
国金基金管理有限公司	-	1,538,652.39	1,538,652.39

国金证券股份有限公司	-	23,338.95	23,338.95
中国光大银行股份有限公司	-	1,099.72	1,099.72
合计	-	1,563,091.06	1,563,091.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
国金基金管理有限公司	-	240,315.26	240,315.26
国金证券股份有限公司	-	2,117.37	2,117.37
合计	-	242,432.63	242,432.63

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无

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

注：无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司-活期存款	2,205,505.10	233,797.83	17,240,671.54	157,645.69

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

流动性风险，有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	156,237,141.96	-	-	-	-	-	156,237,141.96
结算备付金	0.06	-	-	-	-	-	0.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,321,915,801.46	1,321,915,801.46
应收申购款	-	-	-	-	-	3,076,505.86	3,076,505.86
资产总计	156,237,142.02	-	-	-	-	1,324,992,307.32	1,481,229,449.34
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	8,277.90	8,277.90
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,944,176.17	45,944,176.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,740,169.92	1,740,169.92
应付托管费	-	-	-	-	-	290,028.32	290,028.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	231,894.77	231,894.77
其他负债	-	-	-	-	-	211,162.74	211,162.74
负债总计	-	-	-	-	-	48,425,709.82	48,425,709.82
利率敏感度缺口	156,237,142.02	-	-	-	-	1,276,566,597.50	1,432,803,739.52

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	378,230,571.10	-	-	-	-	-	378,230,571.10
结算备付金	0.06	-	-	-	-	-	0.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-3,785,432,870.94	-3,785,432,870.94
应收申购款	-	-	-	-	-	2,113,880.12	2,113,880.12
资产总计	378,230,571.16	-	-	-	-	-3,787,546,751.06	4,165,777,322.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	90,887,902.91	90,887,902.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,163,042.29	4,163,042.29
应付托管费	-	-	-	-	-	693,840.37	693,840.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	718,838.26	718,838.26
其他负债	-	-	-	-	-	257,735.41	257,735.41
负债总计	-	-	-	-	-	96,721,359.24	96,721,359.24
利率敏感度缺口	378,230,571.16	-	-	-	-	-3,690,825,391.82	4,069,055,962.98

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	1,321,915,801.46	92.26	3,785,432,870.94	93.03
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	1,321,915,801.46	92.26	3,785,432,870.94	93.03

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数 (000300.SH) 变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
分析	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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	+5%	72,279,476.01	148,917,960.36
	-5%	-72,279,476.01	-148,917,960.36

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,321,915,801.46	3,785,426,788.80
第二层次	-	-
第三层次	-	6,082.14
合计	1,321,915,801.46	3,785,432,870.94

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,321,915,801.46	89.24
	其中：股票	1,321,915,801.46	89.24

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	156,237,142.02	10.55
8	其他各项资产	3,076,505.86	0.21
9	合计	1,481,229,449.34	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,301,939.00	0.09
B	采矿业	23,932,220.00	1.67
C	制造业	887,936,777.19	61.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,982,178.64	0.98
E	建筑业	37,867,512.00	2.64
F	批发和零售业	10,187,765.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	43,962,429.00	3.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,556,200.29	6.53
J	金融业	192,968,635.15	13.47
K	房地产业	3,725,988.00	0.26
L	租赁和商务服务业	4,600,435.55	0.32
M	科学研究和技术服务业	2,484,946.64	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	2,241,704.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	262,768.00	0.02
Q	卫生和社会工作	322,761.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	2,581,542.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	1,321,915,801.46	92.26

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	605499	东鹏饮料	292,600	63,128,450.00	4.41
2	600999	招商证券	3,409,101	47,420,594.91	3.31
3	600104	上汽集团	3,362,960	46,610,625.60	3.25
4	000651	格力电器	1,023,300	40,133,826.00	2.80
5	603501	韦尔股份	401,300	39,877,181.00	2.78
6	000333	美的集团	601,800	38,816,100.00	2.71
7	600519	贵州茅台	24,698	36,241,598.22	2.53
8	601728	中国电信	5,269,500	32,407,425.00	2.26
9	600018	上港集团	4,936,500	28,532,970.00	1.99
10	601766	中国中车	3,753,300	28,187,283.00	1.97
11	000338	潍柴动力	1,670,300	27,125,672.00	1.89
12	000301	东方盛虹	3,348,100	26,684,357.00	1.86
13	688041	海光信息	374,184	26,312,618.88	1.84
14	601211	国泰君安	1,870,200	25,341,210.00	1.77
15	688538	和辉光电	12,796,596	25,337,260.08	1.77
16	000063	中兴通讯	855,633	23,932,055.01	1.67
17	000725	京东方 A	5,498,500	22,488,865.00	1.57
18	601138	工业富联	820,000	22,468,000.00	1.57
19	601668	中国建筑	4,013,700	21,312,747.00	1.49
20	601066	中信建投	1,091,171	20,994,130.04	1.47
21	600887	伊利股份	764,500	19,754,680.00	1.38
22	600690	海尔智家	695,800	19,746,804.00	1.38
23	600050	中国联通	4,106,500	19,300,550.00	1.35
24	600309	万华化学	238,400	19,277,024.00	1.35
25	601229	上海银行	2,623,506	19,046,653.56	1.33
26	000703	恒逸石化	2,668,100	18,916,829.00	1.32
27	600019	宝钢股份	2,716,200	18,062,730.00	1.26
28	600741	华域汽车	998,820	16,360,671.60	1.14
29	600015	华夏银行	2,530,100	16,192,640.00	1.13
30	601601	中国太保	555,800	15,484,588.00	1.08
31	300750	宁德时代	82,980	14,938,889.40	1.04
32	601012	隆基绿能	1,036,256	14,528,309.12	1.01
33	600377	宁沪高速	1,151,800	14,512,680.00	1.01
34	601898	中煤能源	1,119,500	13,971,360.00	0.98
35	002371	北方华创	42,100	13,467,369.00	0.94
36	601877	正泰电器	695,220	13,250,893.20	0.92
37	600346	恒力石化	930,200	12,976,290.00	0.91
38	600900	长江电力	442,667	12,801,929.64	0.89
39	600809	山西汾酒	58,400	12,315,392.00	0.86

40	002153	石基信息	1,796,570	10,294,346.10	0.72
41	603993	洛阳钼业	1,158,900	9,850,650.00	0.69
42	600989	宝丰能源	543,000	9,410,190.00	0.66
43	601800	中国交建	1,042,600	9,320,844.00	0.65
44	601688	华泰证券	745,500	9,236,745.00	0.64
45	002841	视源股份	303,518	8,962,886.54	0.63
46	601169	北京银行	1,503,321	8,779,394.64	0.61
47	000568	泸州老窖	58,400	8,379,816.00	0.58
48	601319	中国人保	1,579,400	8,133,910.00	0.57
49	601658	邮储银行	1,596,800	8,095,776.00	0.57
50	601127	赛力斯	81,200	7,398,944.00	0.52
51	601318	中国平安	177,500	7,341,400.00	0.51
52	601568	北元集团	1,835,740	6,810,595.40	0.48
53	600655	豫园股份	1,072,100	5,521,315.00	0.39
54	601633	长城汽车	211,700	5,356,010.00	0.37
55	600150	中国船舶	128,100	5,214,951.00	0.36
56	600893	航发动力	137,000	5,007,350.00	0.35
57	600000	浦发银行	588,500	4,843,355.00	0.34
58	688111	金山办公	20,911	4,757,252.50	0.33
59	601186	中国铁建	539,700	4,625,229.00	0.32
60	002415	海康威视	138,900	4,293,399.00	0.30
61	000825	太钢不锈	1,229,000	4,154,020.00	0.29
62	601600	中国铝业	506,545	3,864,938.35	0.27
63	601216	君正集团	1,037,600	3,828,744.00	0.27
64	603429	集友股份	819,900	3,402,585.00	0.24
65	600660	福耀玻璃	61,900	2,965,010.00	0.21
66	601989	中国重工	582,100	2,869,753.00	0.20
67	688819	天能股份	112,452	2,683,104.72	0.19
68	600941	中国移动	24,500	2,633,750.00	0.18
69	600760	中航沈飞	62,700	2,514,270.00	0.18
70	600848	上海临港	255,400	2,326,694.00	0.16
71	000709	河钢股份	1,154,100	2,238,954.00	0.16
72	000708	中信特钢	163,800	2,222,766.00	0.16
73	600036	招商银行	60,200	2,058,238.00	0.14
74	601106	中国一重	870,800	2,011,548.00	0.14
75	000596	古井贡酒	9,300	1,962,951.00	0.14
76	301052	果麦文化	95,084	1,949,222.00	0.14
77	300380	安硕信息	110,100	1,691,136.00	0.12
78	600616	金枫酒业	325,000	1,560,000.00	0.11
79	603369	今世缘	33,698	1,556,847.60	0.11
80	300707	威唐工业	121,100	1,499,218.00	0.10
81	300543	朗科智能	180,300	1,442,400.00	0.10
82	300730	科创信息	129,300	1,343,427.00	0.09

83	300486	东杰智能	212,900	1,222,046.00	0.09
84	300562	乐心医疗	134,000	1,193,940.00	0.08
85	300884	狄耐克	136,800	1,179,216.00	0.08
86	301007	德迈仕	96,000	1,121,280.00	0.08
87	601828	美凯龙	432,841	1,103,744.55	0.08
88	688036	传音控股	14,397	1,101,946.38	0.08
89	301185	鸥玛软件	75,600	1,083,348.00	0.08
90	300780	德恩精工	78,100	1,053,569.00	0.07
91	300771	智莱科技	118,300	1,039,857.00	0.07
92	300943	春晖智控	94,500	1,019,655.00	0.07
93	300281	金明精机	224,900	1,014,299.00	0.07
94	301169	零点有数	34,000	979,200.00	0.07
95	301313	凡拓数创	47,700	970,695.00	0.07
96	300279	和晶科技	215,500	898,635.00	0.06
97	301159	三维天地	33,500	893,445.00	0.06
98	002272	川润股份	198,900	891,072.00	0.06
99	300295	三六五网	98,400	883,632.00	0.06
100	002595	豪迈科技	22,900	874,093.00	0.06
101	603887	城地香江	166,900	869,549.00	0.06
102	688071	华依科技	39,610	858,348.70	0.06
103	603527	众源新材	120,400	854,840.00	0.06
104	002963	豪尔赛	83,500	854,205.00	0.06
105	002347	泰尔股份	223,300	841,841.00	0.06
106	002769	普路通	158,500	828,955.00	0.06
107	301380	挖金客	25,200	807,408.00	0.06
108	300611	美力科技	105,500	803,910.00	0.06
109	301045	天禄科技	40,700	775,742.00	0.05
110	300828	锐新科技	64,900	770,363.00	0.05
111	301396	宏景科技	39,000	760,890.00	0.05
112	300823	建科智能	61,220	743,823.00	0.05
113	300810	中科海讯	48,500	742,535.00	0.05
114	688369	致远互联	47,161	741,842.53	0.05
115	300949	奥雅股份	24,800	739,288.00	0.05
116	300921	南凌科技	42,300	732,636.00	0.05
117	605136	丽人丽妆	132,800	731,728.00	0.05
118	300922	天秦装备	56,300	731,337.00	0.05
119	300387	富邦股份	120,300	720,597.00	0.05
120	300508	维宏股份	36,700	713,081.00	0.05
121	300379	东方通	87,500	707,000.00	0.05
122	603333	尚纬股份	222,300	691,353.00	0.05
123	301213	观想科技	25,300	690,943.00	0.05
124	300269	联建光电	272,800	684,728.00	0.05
125	002796	世嘉科技	84,900	674,955.00	0.05

126	300235	方直科技	83,600	670,472.00	0.05
127	300112	万讯自控	96,900	668,610.00	0.05
128	300254	仟源医药	84,900	667,314.00	0.05
129	301067	显盈科技	33,400	658,314.00	0.05
130	300414	中光防雷	99,300	656,373.00	0.05
131	002931	锋龙股份	64,000	652,160.00	0.05
132	002858	力盛体育	60,800	632,320.00	0.04
133	301298	东利机械	49,300	628,575.00	0.04
134	301360	荣旗科技	14,500	627,125.00	0.04
135	301326	捷邦科技	19,200	624,768.00	0.04
136	300539	横河精密	77,500	623,875.00	0.04
137	300731	科创新源	42,600	623,664.00	0.04
138	603829	洛凯股份	51,900	613,977.00	0.04
139	300553	集智股份	24,900	609,801.00	0.04
140	300410	正业科技	118,600	607,232.00	0.04
141	300515	三德科技	61,300	605,031.00	0.04
142	300280	紫天科技	39,700	605,028.00	0.04
143	688080	映翰通	19,921	604,203.93	0.04
144	002286	保龄宝	109,500	603,345.00	0.04
145	603051	鹿山新材	27,600	602,508.00	0.04
146	000586	汇源通信	76,300	598,955.00	0.04
147	688662	富信科技	24,336	593,798.40	0.04
148	300473	德尔股份	43,400	590,674.00	0.04
149	300076	GQY 视讯	184,500	590,400.00	0.04
149	600476	湘邮科技	49,200	590,400.00	0.04
150	300694	蠡湖股份	69,300	589,743.00	0.04
151	002682	龙洲股份	164,800	586,688.00	0.04
152	301119	正强股份	30,900	584,628.00	0.04
153	301321	翰博高新	50,200	577,802.00	0.04
154	301056	森赫股份	74,500	571,415.00	0.04
155	603683	晶华新材	71,900	570,886.00	0.04
156	002968	新大正	62,600	557,766.00	0.04
157	300517	海波重科	64,700	554,479.00	0.04
158	603089	正裕工业	66,200	553,432.00	0.04
159	301003	江苏博云	25,500	548,505.00	0.04
160	688218	江苏北人	30,985	545,645.85	0.04
161	301022	海泰科	27,600	545,100.00	0.04
162	301209	联合化学	24,800	543,120.00	0.04
163	605180	华生科技	45,800	542,730.00	0.04
164	688365	光云科技	89,821	540,722.42	0.04
165	002231	奥维通信	129,500	528,360.00	0.04
166	300710	万隆光电	34,735	526,929.95	0.04
167	605255	天普股份	43,500	522,870.00	0.04

168	300628	亿联网络	14,200	522,134.00	0.04
169	000020	深华发 A	52,600	520,740.00	0.04
170	603090	宏盛股份	29,100	518,562.00	0.04
171	603286	日盈电子	32,400	516,132.00	0.04
172	300789	唐源电气	38,500	509,740.00	0.04
173	002998	优彩资源	89,000	504,630.00	0.04
174	603321	梅轮电梯	73,800	504,054.00	0.04
175	300652	雷迪克	25,400	503,682.00	0.04
176	300767	震安科技	59,200	502,016.00	0.04
177	002825	纳尔股份	80,100	499,023.00	0.03
178	300277	海联讯	74,000	498,760.00	0.03
179	300987	川网传媒	41,040	498,225.60	0.03
180	300605	恒锋信息	54,600	494,676.00	0.03
181	688055	龙腾光电	154,795	490,700.15	0.03
182	603982	泉峰汽车	60,500	484,000.00	0.03
183	603045	福达合金	48,300	479,619.00	0.03
184	600770	综艺股份	209,400	479,526.00	0.03
185	600665	天地源	215,900	479,298.00	0.03
186	300264	佳创视讯	121,600	477,888.00	0.03
187	603106	恒银科技	111,400	474,564.00	0.03
188	300753	爱朋医疗	43,200	473,040.00	0.03
189	605208	永茂泰	74,900	466,627.00	0.03
190	688255	凯尔达	22,870	458,543.50	0.03
191	603110	东方材料	41,100	457,443.00	0.03
192	688737	中自科技	28,035	454,167.00	0.03
193	002164	宁波东力	115,900	445,056.00	0.03
194	603048	浙江黎明	30,200	438,504.00	0.03
195	688316	青云科技	14,502	433,754.82	0.03
196	688511	天微电子	19,875	432,678.75	0.03
197	688109	品茗科技	15,691	429,148.85	0.03
198	603656	泰禾智能	39,300	426,798.00	0.03
199	001296	长江材料	29,300	417,525.00	0.03
200	300743	天地数码	30,700	415,678.00	0.03
201	603729	龙韵股份	31,300	415,038.00	0.03
202	688175	高凌信息	27,846	411,563.88	0.03
203	603221	爱丽家居	46,300	410,681.00	0.03
204	301112	信邦智能	18,900	409,941.00	0.03
205	688307	中润光学	19,778	409,206.82	0.03
206	301118	恒光股份	27,200	405,552.00	0.03
207	603937	丽岛新材	52,000	403,520.00	0.03
208	002774	快意电梯	63,500	403,225.00	0.03
209	300074	华平股份	123,100	402,537.00	0.03
210	002576	通达动力	34,900	396,115.00	0.03

211	300018	中元股份	86,100	396,060.00	0.03
212	300853	申昊科技	27,100	394,034.00	0.03
213	688292	浩瀚深度	25,431	393,163.26	0.03
214	688189	南新制药	69,189	389,534.07	0.03
215	001317	三羊马	16,500	387,585.00	0.03
216	002861	瀛通通讯	35,900	383,771.00	0.03
217	688078	龙软科技	16,661	383,702.83	0.03
218	688291	金橙子	22,063	379,924.86	0.03
219	300871	回盛生物	39,800	379,692.00	0.03
220	002451	摩恩电气	70,600	379,122.00	0.03
221	301378	通达海	17,400	377,580.00	0.03
222	688571	杭华股份	70,297	371,871.13	0.03
223	300932	三友联众	38,600	371,718.00	0.03
224	003002	壶化股份	33,700	369,689.00	0.03
225	600359	新农开发	65,900	368,381.00	0.03
226	600097	开创国际	44,600	367,058.00	0.03
227	300549	优德精密	27,100	366,392.00	0.03
228	603811	诚意药业	58,000	362,500.00	0.03
229	688148	芳源股份	85,909	361,676.89	0.03
230	002209	达意隆	47,300	360,899.00	0.03
231	002369	卓翼科技	97,800	360,882.00	0.03
232	002671	龙泉股份	100,000	359,000.00	0.03
233	301023	江南奕帆	11,800	358,130.00	0.02
234	603928	兴业股份	45,700	357,831.00	0.02
235	603725	天安新材	57,400	356,454.00	0.02
236	300234	开尔新材	89,500	355,315.00	0.02
237	000510	新金路	126,700	350,959.00	0.02
238	300420	五洋自控	160,000	350,400.00	0.02
239	603185	弘元绿能	20,500	350,345.00	0.02
240	603331	百达精工	38,600	350,102.00	0.02
241	300907	康平科技	18,400	349,416.00	0.02
242	603810	丰山集团	41,600	347,776.00	0.02
243	603311	金海高科	40,600	345,912.00	0.02
244	002213	大为股份	35,300	344,175.00	0.02
245	002442	龙星化工	79,400	341,420.00	0.02
246	600540	新赛股份	99,600	339,636.00	0.02
247	300141	和顺电气	41,200	338,252.00	0.02
248	603161	科华控股	22,500	336,825.00	0.02
249	603122	合富中国	66,000	335,940.00	0.02
250	300819	聚杰微纤	28,900	334,373.00	0.02
251	300615	欣天科技	34,900	333,993.00	0.02
252	688186	广大特材	34,044	331,248.12	0.02
253	301077	星华新材	18,500	330,410.00	0.02

254	300986	志特新材	48,700	329,699.00	0.02
255	002365	永安药业	45,600	329,232.00	0.02
256	300004	南风股份	75,600	328,104.00	0.02
257	002492	恒基达鑫	71,200	327,520.00	0.02
258	301197	工大科雅	24,700	324,064.00	0.02
259	301055	张小泉	27,300	323,778.00	0.02
260	603917	合力科技	29,800	322,436.00	0.02
261	600386	北巴传媒	115,000	320,850.00	0.02
262	002817	黄山胶囊	59,700	318,798.00	0.02
263	601888	中国中免	5,100	318,699.00	0.02
264	300879	大叶股份	23,800	318,444.00	0.02
265	603336	宏辉果蔬	105,700	318,157.00	0.02
266	300980	祥源新材	20,100	316,776.00	0.02
267	300247	融捷健康	130,300	316,629.00	0.02
268	300588	熙菱信息	40,900	316,566.00	0.02
269	300746	汉嘉设计	50,100	314,628.00	0.02
270	300153	科泰电源	52,800	314,160.00	0.02
271	300126	锐奇股份	69,300	313,929.00	0.02
272	603790	雅运股份	32,600	312,960.00	0.02
273	000626	远大控股	75,300	312,495.00	0.02
274	688171	纬德信息	20,614	310,859.12	0.02
275	300883	龙利得	73,400	310,482.00	0.02
276	301032	新柴股份	46,200	310,002.00	0.02
277	603038	华立股份	42,400	309,944.00	0.02
278	002753	永东股份	53,200	309,092.00	0.02
279	603798	康普顿	36,700	309,014.00	0.02
280	603926	铁流股份	37,100	307,930.00	0.02
281	603577	汇金通	44,300	307,442.00	0.02
282	300211	亿通科技	57,900	306,291.00	0.02
283	300509	新美星	65,400	306,072.00	0.02
284	603080	新疆火炬	22,700	305,542.00	0.02
285	688585	上纬新材	58,501	302,450.17	0.02
286	603022	新通联	41,500	302,120.00	0.02
287	603238	诺邦股份	30,300	301,788.00	0.02
288	301157	华塑科技	9,200	299,920.00	0.02
289	300464	星徽股份	85,200	299,904.00	0.02
290	688199	久日新材	22,324	299,141.60	0.02
291	001234	泰慕士	17,600	299,024.00	0.02
292	600235	民丰特纸	65,000	299,000.00	0.02
293	001209	洪兴股份	21,600	298,080.00	0.02
294	688092	爱科科技	13,840	295,484.00	0.02
295	300813	泰林生物	17,400	294,930.00	0.02
296	603988	中电电机	37,700	294,437.00	0.02

297	688616	西力科技	25,894	293,637.96	0.02
298	001368	通达创智	15,000	293,250.00	0.02
299	688613	奥精医疗	22,989	292,649.97	0.02
300	300651	金陵体育	24,100	292,092.00	0.02
301	300701	森霸传感	34,700	291,827.00	0.02
302	002873	新天药业	35,100	291,330.00	0.02
303	301066	万事利	35,800	289,980.00	0.02
304	300865	大宏立	17,900	287,116.00	0.02
305	301234	五洲医疗	13,200	285,780.00	0.02
306	605001	威奥股份	58,600	285,382.00	0.02
307	301016	雷尔伟	16,900	284,427.00	0.02
308	000565	渝三峡 A	69,700	280,891.00	0.02
309	003003	天元股份	35,100	279,747.00	0.02
310	603903	中持股份	39,900	279,699.00	0.02
311	600470	六国化工	72,900	278,478.00	0.02
312	603385	惠达卫浴	50,400	276,696.00	0.02
313	603079	圣达生物	27,500	276,100.00	0.02
314	605288	凯迪股份	8,900	275,544.00	0.02
315	600249	两面针	74,900	274,883.00	0.02
316	601002	晋亿实业	94,700	274,630.00	0.02
317	301075	多瑞医药	17,200	273,480.00	0.02
318	688509	正元地信	94,376	272,746.64	0.02
319	603216	梦天家居	29,600	271,728.00	0.02
320	300095	华伍股份	49,300	271,643.00	0.02
321	600960	渤海汽车	101,200	269,192.00	0.02
322	001218	丽臣实业	17,900	267,963.00	0.02
323	301043	绿岛风	11,200	267,344.00	0.02
324	688077	大地熊	16,781	265,643.23	0.02
325	603150	万朗磁塑	10,600	265,424.00	0.02
326	600858	银座股份	67,500	265,275.00	0.02
327	002566	益盛药业	43,300	264,996.00	0.02
328	301081	严牌股份	35,300	264,750.00	0.02
329	688168	安博通	9,820	264,158.00	0.02
330	688529	豪森智能	19,607	263,518.08	0.02
331	002743	富煌钢构	71,400	263,466.00	0.02
332	603677	奇精机械	22,600	263,290.00	0.02
333	301290	东星医疗	13,200	262,812.00	0.02
334	603028	赛福天	46,500	261,795.00	0.02
335	000633	合金投资	66,400	261,616.00	0.02
336	002066	瑞泰科技	32,900	261,555.00	0.02
337	300610	晨化股份	29,700	260,469.00	0.02
338	688667	菱电电控	6,380	260,304.00	0.02
339	003036	泰坦股份	32,400	258,876.00	0.02

340	002972	科安达	28,200	258,312.00	0.02
341	600099	林海股份	37,500	258,000.00	0.02
342	603332	苏州龙杰	35,000	257,950.00	0.02
343	301161	唯万密封	16,600	257,798.00	0.02
344	301053	远信工业	12,900	257,484.00	0.02
345	002809	红墙股份	35,800	256,686.00	0.02
346	603041	美思德	25,600	256,000.00	0.02
347	300022	吉峰科技	72,100	255,955.00	0.02
348	603378	亚士创能	50,500	255,530.00	0.02
349	688323	瑞华泰	25,154	253,300.78	0.02
350	300584	海辰药业	16,600	252,818.00	0.02
351	605287	德才股份	20,000	251,800.00	0.02
352	603192	汇得科技	18,700	251,141.00	0.02
353	688448	磁谷科技	13,194	249,102.72	0.02
354	300621	维业股份	33,500	248,905.00	0.02
355	300148	天舟文化	106,800	246,708.00	0.02
356	688669	聚石化学	21,748	246,187.36	0.02
357	301198	喜悦智行	30,700	245,907.00	0.02
358	301355	南王科技	25,600	245,504.00	0.02
359	600148	长春一东	20,600	245,140.00	0.02
360	600405	动力源	67,800	244,758.00	0.02
361	000790	华神科技	70,600	244,276.00	0.02
362	002337	赛象科技	64,100	243,580.00	0.02
363	603958	哈森股份	29,800	243,466.00	0.02
364	000985	大庆华科	19,300	243,180.00	0.02
365	002394	联发股份	39,300	242,088.00	0.02
366	603036	如通股份	22,500	239,625.00	0.02
367	300449	汉邦高科	57,000	238,830.00	0.02
368	300897	山科智能	12,900	237,876.00	0.02
369	688026	洁特生物	23,876	237,804.96	0.02
370	603949	雪龙集团	20,900	235,334.00	0.02
371	300912	凯龙高科	25,100	235,187.00	0.02
372	300837	浙矿股份	11,300	234,588.00	0.02
373	300935	盈建科	15,100	234,201.00	0.02
374	300876	蒙泰高新	13,600	233,648.00	0.02
375	002691	冀凯股份	53,200	233,548.00	0.02
376	688058	宝兰德	11,211	233,525.13	0.02
377	002571	德力股份	47,800	232,786.00	0.02
378	600714	金瑞矿业	32,100	230,478.00	0.02
379	301063	海锅股份	16,000	229,440.00	0.02
380	603700	宁水集团	24,300	227,934.00	0.02
381	603326	我乐家居	40,900	227,404.00	0.02
382	605336	帅丰电器	20,100	226,527.00	0.02

383	003027	同兴环保	18,400	226,320.00	0.02
384	301515	港通医疗	11,800	225,852.00	0.02
385	603696	安记食品	33,100	224,418.00	0.02
386	603488	展鹏科技	32,900	223,720.00	0.02
387	603818	曲美家居	79,500	221,805.00	0.02
388	605189	富春染织	20,800	221,728.00	0.02
389	688273	麦澜德	11,194	221,641.20	0.02
390	300658	延江股份	52,400	221,128.00	0.02
391	000663	永安林业	52,300	219,137.00	0.02
392	603607	京华激光	17,500	218,925.00	0.02
393	600130	波导股份	68,600	218,834.00	0.02
394	300340	科恒股份	31,700	218,730.00	0.02
395	600735	新华锦	57,000	218,310.00	0.02
396	600854	春兰股份	63,800	218,196.00	0.02
397	003033	征和工业	9,400	217,798.00	0.02
398	603506	南都物业	25,900	217,042.00	0.02
399	301272	英华特	5,600	216,048.00	0.02
400	688237	超卓航科	10,744	215,417.20	0.02
401	002899	英派斯	16,300	214,671.00	0.01
402	002795	永和智控	57,700	214,644.00	0.01
403	600356	恒丰纸业	36,100	213,712.00	0.01
404	301065	本立科技	13,400	213,060.00	0.01
405	600152	维科技术	44,100	211,680.00	0.01
406	603536	惠发食品	26,500	209,615.00	0.01
407	300016	北陆药业	47,500	209,475.00	0.01
408	001268	联合精密	12,300	208,239.00	0.01
409	600272	开开实业	24,200	208,120.00	0.01
410	688607	康众医疗	16,647	206,755.74	0.01
411	000619	海螺新材	50,400	203,616.00	0.01
412	001202	炬申股份	17,800	201,674.00	0.01
413	300412	迦南科技	68,800	198,144.00	0.01
414	300086	康芝药业	56,400	197,964.00	0.01
415	688030	山石网科	18,919	197,703.55	0.01
416	300958	建工修复	18,500	196,655.00	0.01
417	300892	品渥食品	14,400	196,416.00	0.01
418	605155	西大门	21,440	196,176.00	0.01
419	603177	德创环保	27,900	196,137.00	0.01
420	688386	泛亚微透	6,983	195,942.98	0.01
421	688435	英方软件	7,837	195,611.52	0.01
422	603196	日播时尚	27,700	195,562.00	0.01
423	002909	集泰股份	47,400	194,340.00	0.01
424	301037	保立佳	21,900	194,034.00	0.01
425	002659	凯文教育	59,200	193,584.00	0.01

426	300816	艾可蓝	8,300	193,390.00	0.01
427	688227	品高股份	15,930	192,912.30	0.01
428	603839	安正时尚	44,000	192,280.00	0.01
429	301107	瑜欣电子	7,600	190,760.00	0.01
430	301008	宏昌科技	10,900	190,314.00	0.01
431	600444	国机通用	15,700	190,127.00	0.01
432	300535	达威股份	16,100	189,980.00	0.01
433	001256	炜冈科技	13,800	189,336.00	0.01
434	002376	新北洋	35,100	189,189.00	0.01
435	301353	普莱得	7,500	188,175.00	0.01
436	605566	福莱蒾特	12,300	187,329.00	0.01
437	300960	通业科技	12,400	186,868.00	0.01
438	300642	透景生命	16,000	186,240.00	0.01
439	600371	万向德农	26,900	186,148.00	0.01
440	001230	劲旅环境	13,400	186,126.00	0.01
441	688051	佳华科技	11,176	185,298.08	0.01
442	002084	海鸥住工	75,300	184,485.00	0.01
443	301111	粤万年青	13,200	184,140.00	0.01
444	603176	汇通集团	49,100	183,143.00	0.01
445	688011	新光光电	12,000	181,800.00	0.01
446	300371	汇中股份	21,600	180,792.00	0.01
447	600319	亚星化学	54,500	180,395.00	0.01
448	002942	新农股份	15,300	180,387.00	0.01
449	603976	正川股份	12,600	177,786.00	0.01
450	300032	金龙机电	57,000	177,270.00	0.01
451	605169	洪通燃气	22,600	177,184.00	0.01
452	603682	锦和商管	44,300	176,757.00	0.01
453	300966	共同药业	10,800	176,472.00	0.01
454	603086	先达股份	46,100	175,180.00	0.01
455	002687	乔治白	41,700	175,140.00	0.01
456	603768	常青股份	15,400	174,636.00	0.01
457	603182	嘉华股份	16,600	174,632.00	0.01
458	688681	科汇股份	17,104	174,631.84	0.01
459	300132	青松股份	50,000	174,000.00	0.01
460	001278	一彬科技	11,000	173,910.00	0.01
461	603017	中衡设计	19,600	173,656.00	0.01
462	603329	上海雅仕	15,700	173,014.00	0.01
463	301126	达嘉维康	19,100	172,473.00	0.01
464	000678	襄阳轴承	45,700	171,832.00	0.01
465	300334	津膜科技	36,700	171,756.00	0.01
466	603968	醋化股份	17,300	171,616.00	0.01
467	002172	澳洋健康	69,100	169,986.00	0.01
468	301009	可靠股份	22,700	169,569.00	0.01

469	002949	华阳国际	18,000	169,380.00	0.01
470	301365	矩阵股份	15,300	168,147.00	0.01
471	603330	天洋新材	35,000	167,650.00	0.01
472	300289	利德曼	43,200	166,320.00	0.01
473	001223	欧克科技	4,700	165,393.00	0.01
474	603955	大千生态	19,200	165,120.00	0.01
475	600423	柳化股份	71,000	164,010.00	0.01
476	603151	邦基科技	14,100	162,714.00	0.01
477	001333	光华股份	9,800	161,700.00	0.01
478	301113	雅艺科技	8,100	161,109.00	0.01
479	605068	明新旭腾	12,200	160,796.00	0.01
480	605100	华丰股份	13,820	160,726.60	0.01
481	300299	富春股份	46,200	160,314.00	0.01
482	603115	海星股份	15,400	160,160.00	0.01
483	301300	远翔新材	7,300	159,943.00	0.01
484	301010	晶雪节能	13,700	157,687.00	0.01
485	603137	恒尚节能	15,400	157,080.00	0.01
486	300519	新光药业	14,400	156,240.00	0.01
487	300564	筑博设计	18,300	156,099.00	0.01
488	688379	华光新材	11,381	156,033.51	0.01
489	300335	迪森股份	40,300	155,961.00	0.01
490	603214	爱婴室	13,800	155,802.00	0.01
491	300931	通用电梯	28,400	155,632.00	0.01
492	603655	朗博科技	10,500	155,610.00	0.01
493	300804	广康生化	7,100	154,780.00	0.01
494	603159	上海亚虹	14,800	154,068.00	0.01
495	002136	安纳达	17,000	154,020.00	0.01
496	300571	平治信息	7,300	152,862.00	0.01
497	002524	光正眼科	48,500	152,775.00	0.01
498	688501	青达环保	11,138	152,367.84	0.01
499	301059	金三江	17,100	152,361.00	0.01
500	605122	四方新材	15,600	151,632.00	0.01
501	600128	苏豪弘业	23,800	151,606.00	0.01
502	605151	西上海	10,300	150,895.00	0.01
503	003041	真爱美家	12,200	148,962.00	0.01
504	001238	浙江正特	7,500	148,650.00	0.01
505	300899	上海凯鑫	8,000	148,640.00	0.01
506	001255	博菲电气	6,800	148,512.00	0.01
507	600232	金鹰股份	34,400	148,264.00	0.01
508	300838	浙江力诺	14,400	148,032.00	0.01
509	605003	众望布艺	9,200	147,660.00	0.01
510	600802	福建水泥	52,600	146,228.00	0.01
511	600237	铜峰电子	28,000	146,160.00	0.01

512	605033	美邦股份	11,700	145,314.00	0.01
513	600159	大龙地产	65,400	145,188.00	0.01
514	300877	金春股份	13,300	144,172.00	0.01
515	002866	传艺科技	11,200	144,144.00	0.01
516	688588	凌志软件	21,034	144,082.90	0.01
517	301429	森泰股份	9,400	143,820.00	0.01
518	600243	青海华鼎	52,900	142,301.00	0.01
519	688682	霍莱沃	4,841	142,034.94	0.01
520	603189	网达软件	12,900	141,126.00	0.01
521	600689	上海三毛	20,800	140,400.00	0.01
522	301228	实朴检测	14,800	138,380.00	0.01
523	300955	嘉亨家化	10,900	138,103.00	0.01
524	002890	弘宇股份	17,030	136,580.60	0.01
525	688768	容知日新	5,827	136,410.07	0.01
526	600410	华胜天成	35,200	136,224.00	0.01
527	300521	爱司凯	13,200	135,960.00	0.01
528	300082	奥克股份	31,700	135,042.00	0.01
529	002693	双成药业	30,600	134,640.00	0.01
530	300472	新元科技	29,400	130,242.00	0.01
531	600712	南宁百货	37,000	129,870.00	0.01
532	301098	金埔园林	17,000	128,690.00	0.01
533	301186	超达装备	4,100	128,330.00	0.01
534	688560	明冠新材	12,026	128,076.90	0.01
535	301287	康力源	4,800	127,920.00	0.01
536	603073	彩蝶实业	8,800	127,248.00	0.01
537	688393	安必平	8,145	124,862.85	0.01
538	600678	四川金顶	23,600	122,956.00	0.01
539	002529	海源复材	23,800	122,808.00	0.01
540	002360	同德化工	24,200	122,452.00	0.01
541	300635	中达安	16,200	122,310.00	0.01
542	300190	维尔利	44,200	121,550.00	0.01
543	688557	兰剑智能	5,219	120,976.42	0.01
544	300422	博世科	25,000	119,000.00	0.01
545	002802	洪汇新材	13,400	118,992.00	0.01
546	300599	雄塑科技	23,800	118,286.00	0.01
547	603183	建研院	36,500	117,165.00	0.01
548	300556	丝路视觉	6,900	115,437.00	0.01
549	002686	亿利达	27,500	115,225.00	0.01
550	301227	森鹰窗业	6,100	114,741.00	0.01
551	688229	博睿数据	4,434	114,042.48	0.01
552	301237	和顺科技	4,900	112,014.00	0.01
553	688355	明志科技	8,256	110,795.52	0.01
554	300084	海默科技	20,600	110,210.00	0.01

555	000715	中兴商业	22,900	109,004.00	0.01
556	000803	山高环能	31,100	108,539.00	0.01
557	002787	华源控股	16,000	108,160.00	0.01
558	688360	德马科技	8,968	107,974.72	0.01
559	603822	嘉澳环保	5,700	107,787.00	0.01
560	300329	海伦钢琴	28,400	107,068.00	0.01
561	600051	宁波联合	20,300	106,981.00	0.01
562	605055	迎丰股份	25,600	104,192.00	0.01
563	300692	中环环保	22,400	103,712.00	0.01
564	002853	皮阿诺	13,900	103,277.00	0.01
565	002598	山东章鼓	13,900	103,138.00	0.01
566	301040	中环海陆	10,400	103,064.00	0.01
567	688600	皖仪科技	7,676	102,628.12	0.01
568	300328	宜安科技	23,500	100,580.00	0.01
569	605298	必得科技	11,970	99,351.00	0.01
570	001206	依依股份	7,596	98,899.92	0.01
571	000635	英力特	16,500	96,525.00	0.01
572	002546	新联电子	29,600	96,200.00	0.01
573	301122	采纳股份	5,000	94,150.00	0.01
574	603335	迪生力	22,900	93,890.00	0.01
575	301117	佳缘科技	3,600	92,880.00	0.01
576	603978	深圳新星	10,000	89,500.00	0.01
577	300504	天邑股份	7,300	88,987.00	0.01
578	300923	研奥股份	5,200	88,400.00	0.01
579	688310	迈得医疗	6,508	85,515.12	0.01
580	603095	越剑智能	6,500	85,215.00	0.01
581	301020	密封科技	5,300	83,846.00	0.01
582	688203	海正生材	9,781	83,138.50	0.01
583	300565	科信技术	8,100	81,405.00	0.01
584	300886	华业香料	4,900	80,458.00	0.01
585	300512	中亚股份	13,400	79,328.00	0.01
586	300800	力合科技	7,600	78,736.00	0.01
587	300640	德艺文创	19,300	76,042.00	0.01
588	600281	华阳新材	28,000	73,360.00	0.01
589	603909	建发合诚	8,600	71,552.00	0.00
590	002762	金发拉比	14,000	70,280.00	0.00
591	300176	派生科技	15,700	69,237.00	0.00
592	600455	博通股份	4,700	69,184.00	0.00
593	603059	倍加洁	3,500	69,090.00	0.00
594	603918	金桥信息	6,600	68,970.00	0.00
595	300440	运达科技	13,100	68,775.00	0.00
596	002397	梦洁股份	34,600	66,432.00	0.00
597	688579	山大地纬	8,350	65,547.50	0.00

598	688056	莱伯泰科	2,924	64,795.84	0.00
599	301057	汇隆新材	5,600	64,064.00	0.00
600	600573	惠泉啤酒	7,000	61,320.00	0.00
601	600193	创兴资源	17,500	61,250.00	0.00
602	603102	百合股份	2,000	60,220.00	0.00
603	301021	英诺激光	3,800	59,584.00	0.00
604	002718	友邦吊顶	5,700	59,508.00	0.00
605	002798	帝欧家居	17,900	58,354.00	0.00
606	000419	通程控股	14,100	57,669.00	0.00
607	002731	萃华珠宝	6,800	57,052.00	0.00
608	600844	丹化科技	24,400	56,364.00	0.00
609	603353	和顺石油	4,300	55,728.00	0.00
610	301178	天亿马	2,700	55,701.00	0.00
611	300631	久吾高科	2,900	55,535.00	0.00
612	300608	思特奇	6,100	54,778.00	0.00
613	603188	亚邦股份	23,600	53,336.00	0.00
614	600156	华升股份	17,000	52,870.00	0.00
615	002658	雪迪龙	10,100	51,813.00	0.00
616	300854	中兰环保	5,200	51,688.00	0.00
617	300937	药易购	2,500	50,950.00	0.00
618	600615	丰华股份	5,900	49,914.00	0.00
619	300248	新开普	7,100	46,079.00	0.00
620	300929	华骐环保	6,000	43,920.00	0.00
621	002370	亚太药业	17,400	43,326.00	0.00
622	601218	吉鑫科技	15,500	43,245.00	0.00
623	001210	金房能源	3,200	42,464.00	0.00
624	002883	中设股份	4,700	41,595.00	0.00
625	002982	湘佳股份	2,700	40,716.00	0.00
626	300154	瑞凌股份	7,500	39,975.00	0.00
627	600137	浪莎股份	3,000	35,610.00	0.00
628	603956	威派格	6,700	35,577.00	0.00
629	002848	高斯贝尔	4,700	32,618.00	0.00
630	301203	国泰环保	1,100	31,141.00	0.00
631	300331	苏大维格	1,900	30,552.00	0.00
632	301388	欣灵电气	1,200	29,652.00	0.00
633	002634	棒杰股份	8,200	29,438.00	0.00
634	600228	返利科技	6,000	29,160.00	0.00
635	688067	爱威科技	1,932	27,724.20	0.00
636	300749	顶固集创	5,200	27,560.00	0.00
637	002480	新筑股份	8,700	27,144.00	0.00
638	301336	趣睡科技	900	26,568.00	0.00
639	688028	沃尔德	1,610	26,452.30	0.00
640	002921	联诚精密	2,600	26,026.00	0.00

641	600800	渤海化学	12,800	25,472.00	0.00
642	002474	榕基软件	5,700	24,852.00	0.00
643	603980	吉华集团	6,500	24,310.00	0.00
644	688329	艾隆科技	1,612	23,954.32	0.00
645	002868	绿康生化	1,800	23,940.00	0.00
646	603586	金麒麟	1,600	23,616.00	0.00
647	600838	上海九百	4,200	22,596.00	0.00
648	000593	德龙汇能	4,200	19,572.00	0.00
649	300665	飞鹿股份	3,800	19,266.00	0.00
650	688070	纵横股份	670	18,934.20	0.00
651	603908	牧高笛	900	18,054.00	0.00
652	600202	哈空调	4,500	16,065.00	0.00
653	300157	新锦动力	8,100	14,904.00	0.00
654	688081	兴图新科	1,441	12,680.80	0.00
655	002169	智光电气	2,100	9,261.00	0.00
656	688098	申联生物	1,472	6,138.24	0.00
657	688176	亚虹医药	887	4,532.57	0.00
658	605303	园林股份	600	4,020.00	0.00
659	000929	兰州黄河	400	2,444.00	0.00
660	301135	瑞德智能	100	2,129.00	0.00
661	003005	竞业达	100	2,084.00	0.00
662	300385	雪浪环境	500	1,685.00	0.00
663	002435	ST长康	255,900	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	197,336,969.85	4.85
2	600036	招商银行	188,800,395.43	4.64
3	603501	韦尔股份	183,599,966.50	4.51
4	600519	贵州茅台	160,660,335.56	3.95
5	000333	美的集团	158,924,451.68	3.91
6	601318	中国平安	158,452,760.00	3.89
7	600809	山西汾酒	155,090,049.59	3.81
8	600900	长江电力	135,932,399.79	3.34
9	300760	迈瑞医疗	132,323,023.65	3.25
10	002594	比亚迪	123,470,556.21	3.03
11	601668	中国建筑	121,678,393.00	2.99
12	000001	平安银行	118,759,192.00	2.92
13	000651	格力电器	116,037,316.08	2.85
14	600887	伊利股份	106,163,432.22	2.61
15	601601	中国太保	105,498,414.00	2.59

16	002241	歌尔股份	103,485,396.16	2.54
17	300014	亿纬锂能	96,884,808.75	2.38
18	601728	中国电信	92,733,279.00	2.28
19	605499	东鹏饮料	89,514,518.16	2.20
20	600460	士兰微	88,882,623.97	2.18
21	000596	古井贡酒	86,079,331.08	2.12

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	206,637,647.00	5.08
2	600519	贵州茅台	196,722,040.08	4.83
3	600036	招商银行	190,696,476.24	4.69
4	000858	五粮液	187,874,451.41	4.62
5	600809	山西汾酒	144,982,933.80	3.56
6	603501	韦尔股份	133,762,920.16	3.29
7	300760	迈瑞医疗	132,857,227.13	3.27
8	600900	长江电力	127,816,536.56	3.14
9	600837	海通证券	125,140,042.86	3.08
10	000333	美的集团	124,206,245.24	3.05
11	002594	比亚迪	120,509,859.75	2.96
12	000001	平安银行	118,261,057.39	2.91
13	300433	蓝思科技	111,788,695.89	2.75
14	002600	领益智造	111,772,085.34	2.75
15	002241	歌尔股份	105,911,201.23	2.60
16	000938	紫光股份	103,994,983.00	2.56
17	601668	中国建筑	101,009,114.00	2.48
18	601360	三六零	97,215,582.55	2.39
19	600219	南山铝业	95,688,758.22	2.35
20	600019	宝钢股份	95,403,888.60	2.34
21	300014	亿纬锂能	94,922,888.93	2.33
22	601601	中国太保	93,607,758.59	2.30
23	600023	浙能电力	91,916,492.87	2.26
24	601319	中国人保	91,867,619.00	2.26
25	600745	闻泰科技	88,745,187.63	2.18
26	300474	景嘉微	88,131,329.82	2.17
27	600460	士兰微	87,010,605.17	2.14
28	000596	古井贡酒	86,996,976.89	2.14
29	600887	伊利股份	83,536,811.77	2.05
30	600346	恒力石化	82,921,524.00	2.04

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,132,808,609.76
卖出股票收入（成交）总额	16,562,678,103.41

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,076,505.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,076,505.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国金量化多策略 A	70,865	10,120.23	396,911,675.72	55.34	320,258,224.21	44.66
国金量化多策略 C	10,157	62,111.47	307,253,450.60	48.70	323,612,724.96	51.30
合计	81,022	16,637.90	704,165,126.32	52.24	643,870,949.17	47.76

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持	国金量化多策略 A	2,919,733.42	0.4071
	国金量化多策略 C	436,208.44	0.0691

有本基金			
	合计	3,355,941.86	0.2490

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	国金量化多策略 A	>100
	国金量化多策略 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国金量化多策略 A	>100
	国金量化多策略 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
基金合同生效日（2018年2月1日）基金份额总额	425,485,490.92	-
本报告期期初基金份额总额	1,939,656,883.42	1,680,784,816.18
本报告期基金总申购份额	1,697,101,965.85	894,302,305.68
减：本报告期基金总赎回份额	2,919,588,949.34	1,944,220,946.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	717,169,899.93	630,866,175.56

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	28,175,244,349.32	91.79	14,960,978.57	91.86	-
恒泰证券	2	2,520,242,363.85	8.21	1,325,671.56	8.14	-

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

(1) 基金交易单元的选择标准如下：

- ① 券商经纪人经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；

⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金使用券商交易单元的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华泰证券	-	-	1,115,822,000.00	100.00	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金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	《国金量化多策略灵活配置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	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年01月30日
5	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年01月30日
6	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024年01月30日
7	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 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01月30日
8	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 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01月30日
9	《国金量化多策略灵活配置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
10	《国金基金管理有限公司关于公司	指定披露媒体和本基金	2024年04月16日

	《系统维护的公告》	基金管理人网站	
11	《国金量化多策略灵活配置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
12	《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	2024 年 04 月 30 日
13	《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
14	《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
15	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 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
16	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024 年 6 月 13 日-2024 年 6 月 30 日	405,990,262.55	40,563,152.41	128,346,121.36	318,207,293.60	23.61
	2	2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 5 日	976,959,469.52	1,503,463,025.25	2,480,422,494.77	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延期支付赎回款项、部分延期赎回或者暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；

5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日