

国金量化精选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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
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	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	73

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12 投资组合报告附注	73
§ 8 基金份额持有人信息	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	75
§ 9 开放式基金份额变动	75
§ 10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
10.8 其他重大事件	77
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录	79
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化精选混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化精选	
基金主代码	014805	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 18 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,522,939,356.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化精选 A	国金量化精选 C
下属分级基金的交易代码	014805	014806
报告期末下属分级基金的份额总额	1,235,524,842.34 份	1,287,414,514.55 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	<p>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。</p> <p>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，构建模型选取中中长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。</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	中证 500 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静	袁耀光
	联系电话	010-88005695	010-58560666

电子邮箱	zhangjing@gfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话	4000-2000-18	95568
传真	010-88005666	010-57093382
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100020	100031
法定代表人	邵海波	高迎欣

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 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)	
	国金量化精选 A	国金量化精选 C
本期已实现收益	-795,664,452.79	-762,459,381.53
本期利润	-781,806,513.68	-903,202,854.18
加权平均基金份额 本期利润	-0.4133	-0.4729
本期加权平均净 值利润率	-34.83%	-40.04%
本期基金份额净 值增长率	-16.79%	-17.00%
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	-95,485,052.94	-113,444,073.42

期末可供分配基金份额利润	-0.0773	-0.0881
期末基金资产净值	1,393,351,872.35	1,435,440,383.90
期末基金份额净值	1.1277	1.1150
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	12.77%	11.50%

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

国金量化精选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.78%	0.98%	-5.35%	0.76%	0.57%	0.22%
过去三个月	-4.01%	1.28%	-4.81%	0.91%	0.80%	0.37%
过去六个月	-16.79%	2.16%	-6.22%	1.28%	-10.57%	0.88%
过去一年	-15.85%	1.61%	-12.97%	1.02%	-2.88%	0.59%
自基金合同生效起至今	12.77%	1.29%	-14.70%	0.96%	27.47%	0.33%

国金量化精选 C

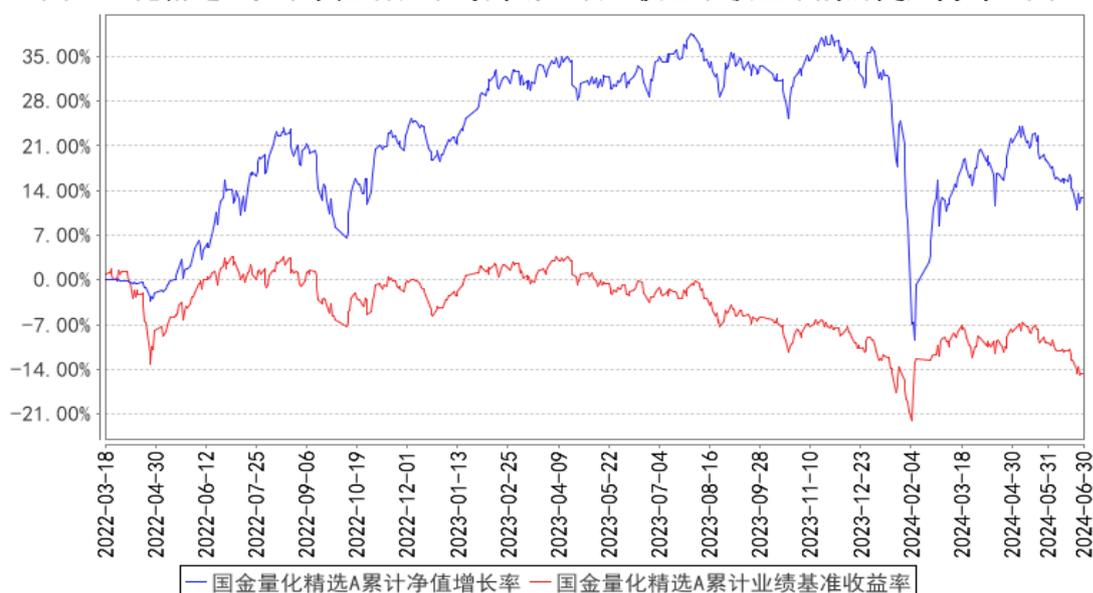
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.81%	0.98%	-5.35%	0.76%	0.54%	0.22%

过去三个月	-4.13%	1.28%	-4.81%	0.91%	0.68%	0.37%
过去六个月	-17.00%	2.16%	-6.22%	1.28%	-	0.88%
过去一年	-16.27%	1.61%	-12.97%	1.02%	-3.30%	0.59%
自基金合同生效起至今	11.50%	1.29%	-14.70%	0.96%	26.20%	0.33%

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

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

国金量化精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国金量化精选C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、C 类份额基金合同生效日为 2022 年 3 月 18 日，图示日期为 2022 年 3 月 18 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	2022 年 3 月 18 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《国金量化精选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 月前后的市场波动是近十年高点，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。具体因子层面：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%。

本基金自 2024 年 2 月回撤以来，回升过程中的收益和风险特征符合对应市场环境下的预期。国金量化策略收益来源多样化、持仓分散度高，量化策略是不断储备和迭代优化的过程，风险模型的优化一定程度降低相对收益的波动。

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 1.1277 元，累计单位净值为 1.1277 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-16.79%，同期业绩比较基准增长率为-6.22%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.1150 元，累计单位净值为 1.1150 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-17.00%，同期业绩比较基准增长率为-6.22%。

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，预期风格切换较为频繁，并伴随市场活跃度较低的特征。但从历史数据看，在较大范围偏离均值的情况下，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，不存在应分配而未分配的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

报告截止日：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	229,323,386.05	468,382,696.99
结算备付金		612.05	4,047,745.03
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,607,289,158.07	7,907,961,162.78
其中：股票投资		2,607,289,158.07	7,907,961,162.78
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	-	149,436,015.90
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		3,999,999.43	180,471,126.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,840,613,155.60	8,710,298,747.08
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2024年6月30日	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		-	-
应付赎回款		7,550,063.55	111,541,299.46
应付管理人报酬		2,960,623.32	8,207,451.77
应付托管费		493,437.24	1,367,908.62
应付销售服务费		615,353.09	1,947,484.99
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	201,422.15	215,450.81
负债合计		11,820,899.35	123,279,595.65

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,522,939,356.89	6,365,737,697.28
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	305,852,899.36	2,221,281,454.15
净资产合计		2,828,792,256.25	8,587,019,151.43
负债和净资产总计		2,840,613,155.60	8,710,298,747.08

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国金量化精选 A 基金份额净值 1.1277 元，基金份额总额 1,235,524,842.34 份；国金量化精选 C 基金份额净值 1.1150 元，基金份额总额 1,287,414,514.55 份。国金量化精选份额总额合计为 2,522,939,356.89 份。

6.2 利润表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

本报告期：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		-1,648,451,776.00	169,476,852.44
1. 利息收入		786,381.11	1,379,872.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	641,600.87	458,927.14
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		144,780.24	920,945.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-1,529,992,807.53	179,243,963.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,560,959,378.41	141,973,010.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	30,966,570.88	37,270,952.72
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	-126,885,533.54	-16,678,237.92
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	7,640,183.96	5,531,254.29
减：二、营业总支出		36,557,591.86	27,772,544.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,499,655.57	20,527,164.88
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,416,609.26	3,421,194.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,518,693.50	3,725,159.01
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	122,633.53	99,026.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-1,685,009,367.86	141,704,308.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-1,685,009,367.86	141,704,308.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,685,009,367.86	141,704,308.34

6.3 净资产变动表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

本报告期：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	6,365,737,697.28	-	2,221,281,454.15	8,587,019,151.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,365,737,697.28	-	2,221,281,454.15	8,587,019,151.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,842,798,340.39	-	-1,915,428,554.79	-5,758,226,895.18
(一)、综合收益总额	-	-	-1,685,009,367.86	-1,685,009,367.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,842,798,340.39	-	-230,419,186.93	-4,073,217,527.32
其中：1. 基金申购款	1,307,086,851.61	-	277,253,760.86	1,584,340,612.47
2. 基金赎回款	-5,149,885,192.00	-	-507,672,947.79	-5,657,558,139.79
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,522,939,356.89	-	305,852,899.36	2,828,792,256.25
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	493,569,785.13	-	94,499,925.45	588,069,710.58
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	493,569,785.13	-	94,499,925.45	588,069,710.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,271,635,423.50	-	1,168,694,551.41	4,440,329,974.91
(一)、综合收益总额	-	-	141,704,308.34	141,704,308.34
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	3,271,635,423.50	-	1,026,990,243.07	4,298,625,666.57
其中：1. 基金申购款	4,796,905,617.49	-	1,500,679,573.33	6,297,585,190.82
2. 基金赎回款	1,525,270,193.99	-	473,689,330.26	1,998,959,524.25
(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	3,765,205,208.63	-	1,263,194,476.86	5,028,399,685.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金量化精选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[2021]4097号文《关于准予国金量化精选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2022年3月18日正式生效，本基金首次募集规模为218,397,464.38份。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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500指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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	1,521,359.27
等于：本金	1,519,980.35
加：应计利息	1,378.92
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	227,802,026.78
等于：本金	227,777,138.78
加：应计利息	24,888.00
减：坏账准备	-
合计	229,323,386.05

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	2,828,359,068.08	-	2,607,289,158.07	- 221,069,910.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,828,359,068.08	-	2,607,289,158.07	- 221,069,910.01

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	3,633.55
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	88,390.22
合计	201,422.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化精选 A

项目	本期 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	2,985,976,281.19	2,985,976,281.19
本期申购	264,841,406.18	264,841,406.18
本期赎回（以“-”号填列）	-2,015,292,845.03	-2,015,292,845.03

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,235,524,842.34	1,235,524,842.34

国金量化精选 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	3,379,761,416.09	3,379,761,416.09
本期申购	1,042,245,445.43	1,042,245,445.43
本期赎回(以“-”号填列)	-3,134,592,346.97	-3,134,592,346.97
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,287,414,514.55	1,287,414,514.55

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

国金量化精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	970,832,215.97	90,060,410.56	1,060,892,626.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	970,832,215.97	90,060,410.56	1,060,892,626.53
本期利润	-795,664,452.79	13,857,939.11	-781,806,513.68
本期基金份额交易产生的变动数	-270,652,816.12	149,393,733.28	-121,259,082.84
其中：基金申购款	57,207,647.67	4,769,635.21	61,977,282.88
基金赎回款	-327,860,463.79	144,624,098.07	-183,236,365.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-95,485,052.94	253,312,082.95	157,827,030.01

国金量化精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,058,778,508.51	101,610,319.11	1,160,388,827.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	1,058,778,508.51	101,610,319.11	1,160,388,827.62
本期利润	-762,459,381.53	-140,743,472.65	-903,202,854.18
本期基金份额交易产生的变动数	-409,763,200.40	300,603,096.31	-109,160,104.09
其中：基金申购款	189,507,797.07	25,768,680.91	215,276,477.98
基金赎回款	-599,270,997.47	274,834,415.40	-324,436,582.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-113,444,073.42	261,469,942.77	148,025,869.35

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	137,370.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	497,619.77
结算备付金利息收入	6,610.75
其他	-
合计	641,600.87

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	-1,560,959,378.41
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,560,959,378.41

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	18,999,114,492.81
减：卖出股票成本总额	20,530,498,270.72
减：交易费用	29,575,600.50
买卖股票差价收入	-1,560,959,378.41

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	30,966,570.88
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	30,966,570.88

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	-126,885,533.54
股票投资	-126,885,533.54
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	-126,885,533.54

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	7,433,274.83
基金转换费收入	206,909.13
合计	7,640,183.96

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	-
银行费用	13,235.15
合计	122,633.53

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
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	26,499,655.57	20,527,164.88
其中：应支付销售机构的客户维 护费	9,681,611.24	7,810,767.94
应支付基金管理人的净管理费	16,818,044.33	12,716,396.94

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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。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。

6.4.10.2.2 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托管费	4,416,609.26	3,421,194.18

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。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。

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		
	国金量化精选 A	国金量化精选 C	合计
国金基金管理有限公司	-	706,903.85	706,903.85
国金证券股份有限公司	-	71,241.63	71,241.63
中国民生银行股份有限公司	-	42,542.28	42,542.28
合计	-	820,687.76	820,687.76
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		
	国金量化精选 A	国金量化精选 C	合计
国金基金管理有限公司	-	638,204.33	638,204.33
国金证券股份有限公司	-	59,011.76	59,011.76
中国民生银行股份有限公司	-	19,439.85	19,439.85
合计	-	716,655.94	716,655.94

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% 的年费率计提。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
中国民生银行股份有限公司-活期存款	1,521,359.27	137,370.35	198,368,921.78	154,683.95

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：本基金本报告期末未进行利润分配。

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	229,323,386.05	-	-	-	-	-	229,323,386.05

结算备付金	612.05	-	-	-	-	-	612.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,607,289,158.07	2,607,289,158.07
应收申购款	-	-	-	-	-	3,999,999.43	3,999,999.43
资产总计	229,323,998.10	-	-	-	-	-2,611,289,157.50	2,840,613,155.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,550,063.55	7,550,063.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,960,623.32	2,960,623.32
应付托管费	-	-	-	-	-	493,437.24	493,437.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	615,353.09	615,353.09
其他负债	-	-	-	-	-	201,422.15	201,422.15
负债总计	-	-	-	-	-	11,820,899.35	11,820,899.35
利率敏感度缺口	229,323,998.10	-	-	-	-	-2,599,468,258.15	2,828,792,256.25
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	468,382,696.99	-	-	-	-	-	468,382,696.99
结算备付金	4,047,745.03	-	-	-	-	-	4,047,745.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-7,907,961,162.78	7,907,961,162.78
买入返售金融资产	149,436,015.90	-	-	-	-	-	149,436,015.90
应收申购款	-	-	-	-	-	180,471,126.38	180,471,126.38
资产总计	621,866,457.92	-	-	-	-	-8,088,432,289.16	8,710,298,747.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	111,541,299.46	111,541,299.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,207,451.77	8,207,451.77
应付托管费	-	-	-	-	-	1,367,908.62	1,367,908.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,947,484.99	1,947,484.99
其他负债	-	-	-	-	-	215,450.81	215,450.81
负债总计	-	-	-	-	-	123,279,595.65	123,279,595.65
利率敏感度缺口	621,866,457.92	-	-	-	-	-7,965,152,693.51	8,587,019,151.43

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	2,607,289,158.07	92.17	7,907,961,162.78	92.09
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	2,607,289,158.07	92.17	7,907,961,162.78	92.09

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变；
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。
	对资产负债表日基金资产净值的

分析	相关风险变量的变动	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%	105,773,658.31	367,199,799.58
-5%	-105,773,658.31	-367,199,799.58	

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	2,607,289,158.07	7,899,693,409.94
第二层次	-	8,261,670.70
第三层次	-	6,082.14
合计	2,607,289,158.07	7,907,961,162.78

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	2,607,289,158.07	91.79
	其中：股票	2,607,289,158.07	91.79
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	229,323,998.10	8.07
8	其他各项资产	3,999,999.43	0.14
9	合计	2,840,613,155.60	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	1,522,034.00	0.05
B	采矿业	71,102,544.00	2.51
C	制造业	1,867,321,835.96	66.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,120,466.71	1.81
E	建筑业	58,044,667.00	2.05

F	批发和零售业	42,753,371.66	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	34,823,987.00	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	295,369,694.55	10.44
J	金融业	93,330,625.73	3.30
K	房地产业	2,369,751.00	0.08
L	租赁和商务服务业	16,227,382.50	0.57
M	科学研究和技术服务业	19,070,544.94	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	24,889,821.52	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,571,420.00	0.30
Q	卫生和社会工作	769,635.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	16,334,221.50	0.58
S	综合	3,667,155.00	0.13
	合计	2,607,289,158.07	92.17

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	603501	韦尔股份	399,335	39,681,918.95	1.40
2	000651	格力电器	939,800	36,858,956.00	1.30
3	601728	中国电信	4,895,200	30,105,480.00	1.06
4	600900	长江电力	1,033,700	29,894,604.00	1.06
5	601127	赛力斯	273,900	24,957,768.00	0.88
6	000063	中兴通讯	841,000	23,522,770.00	0.83
7	000333	美的集团	349,371	22,534,429.50	0.80
8	600690	海尔智家	765,800	21,733,404.00	0.77
9	601766	中国中车	2,858,700	21,468,837.00	0.76
10	601686	友发集团	4,231,942	21,286,668.26	0.75
11	600050	中国联通	4,161,600	19,559,520.00	0.69
12	600019	宝钢股份	2,709,461	18,017,915.65	0.64
13	002236	大华股份	1,164,400	18,001,624.00	0.64
14	601877	正泰电器	879,600	16,765,176.00	0.59
15	601668	中国建筑	3,156,400	16,760,484.00	0.59
16	600887	伊利股份	610,160	15,766,534.40	0.56
17	600346	恒力石化	1,035,396	14,443,774.20	0.51
18	600809	山西汾酒	65,900	13,896,992.00	0.49
19	600183	生益科技	600,300	12,642,318.00	0.45

20	600808	马钢股份	6,249,800	12,624,596.00	0.45
21	600219	南山铝业	3,249,150	12,379,261.50	0.44
22	601865	福莱特	609,800	12,256,980.00	0.43
23	600941	中国移动	113,500	12,201,250.00	0.43
24	600989	宝丰能源	703,700	12,195,121.00	0.43
25	600707	彩虹股份	1,775,500	12,091,155.00	0.43
26	605499	东鹏饮料	55,100	11,887,825.00	0.42
27	600623	华谊集团	2,040,400	11,793,512.00	0.42
28	600377	宁沪高速	933,200	11,758,320.00	0.42
29	002841	视源股份	385,100	11,372,003.00	0.40
30	300207	欣旺达	739,839	11,223,357.63	0.40
31	601231	环旭电子	673,200	10,804,860.00	0.38
32	600362	江西铜业	448,400	10,618,112.00	0.38
33	601898	中煤能源	839,200	10,473,216.00	0.37
34	601169	北京银行	1,785,896	10,429,632.64	0.37
35	601609	金田股份	1,800,100	10,188,566.00	0.36
36	601568	北元集团	2,733,690	10,141,989.90	0.36
37	002532	天山铝业	1,242,400	10,075,864.00	0.36
38	601229	上海银行	1,372,500	9,964,350.00	0.35
39	601800	中国交建	1,113,500	9,954,690.00	0.35
40	000066	中国长城	1,136,300	9,942,625.00	0.35
41	300408	三环集团	335,000	9,778,650.00	0.35
42	002436	兴森科技	905,700	9,346,824.00	0.33
43	605166	聚合顺	881,600	9,247,984.00	0.33
44	601818	光大银行	2,895,100	9,177,467.00	0.32
45	601001	晋控煤业	548,200	9,056,264.00	0.32
46	600985	淮北矿业	534,300	8,944,182.00	0.32
47	601998	中信银行	1,322,700	8,862,090.00	0.31
48	600261	阳光照明	3,158,700	8,528,490.00	0.30
49	002185	华天科技	1,027,200	8,371,680.00	0.30
50	601633	长城汽车	319,700	8,088,410.00	0.29
51	603893	瑞芯微	135,100	7,993,867.00	0.28
52	600566	济川药业	247,600	7,851,396.00	0.28
53	002371	北方华创	24,300	7,773,327.00	0.27
54	300724	捷佳伟创	143,500	7,750,435.00	0.27
55	688819	天能股份	324,366	7,739,372.76	0.27
56	600015	华夏银行	1,204,456	7,708,518.40	0.27
57	002607	中公教育	5,024,200	7,687,026.00	0.27
58	601366	利群股份	1,694,842	7,626,789.00	0.27
59	603012	创力集团	1,700,204	7,582,909.84	0.27
60	002625	光启技术	432,900	7,510,815.00	0.27
61	600282	南钢股份	1,507,700	7,508,346.00	0.27
62	601186	中国铁建	872,700	7,479,039.00	0.26

63	002036	联创电子	1,091,076	7,364,763.00	0.26
64	600968	海油发展	1,762,900	7,263,148.00	0.26
65	688167	炬光科技	131,081	7,209,455.00	0.25
66	601567	三星医疗	202,800	7,098,000.00	0.25
67	600582	天地科技	1,013,700	6,984,393.00	0.25
68	300088	长信科技	1,481,300	6,962,110.00	0.25
69	600782	新钢股份	2,090,300	6,939,796.00	0.25
70	000636	风华高科	528,300	6,899,598.00	0.24
71	603160	汇顶科技	99,400	6,833,750.00	0.24
72	601336	新华保险	225,581	6,774,197.43	0.24
73	600096	云天化	344,900	6,697,958.00	0.24
74	000513	丽珠集团	177,300	6,597,333.00	0.23
75	300782	卓胜微	84,700	6,584,578.00	0.23
76	600498	烽火通信	411,700	6,546,030.00	0.23
77	603700	宁水集团	675,680	6,337,878.40	0.22
78	002241	歌尔股份	321,700	6,276,367.00	0.22
79	600018	上港集团	1,084,000	6,265,520.00	0.22
80	600398	海澜之家	671,300	6,202,812.00	0.22
81	601216	君正集团	1,670,900	6,165,621.00	0.22
82	603113	金能科技	1,123,249	6,144,172.03	0.22
83	603260	合盛硅业	131,140	6,125,549.40	0.22
84	600104	上汽集团	441,400	6,117,804.00	0.22
85	300379	东方通	750,400	6,063,232.00	0.21
86	688538	和辉光电	3,047,963	6,034,966.74	0.21
87	300433	蓝思科技	326,200	5,953,150.00	0.21
88	600776	东方通信	603,950	5,936,828.50	0.21
89	603328	依顿电子	748,300	5,881,638.00	0.21
90	601600	中国铝业	763,500	5,825,505.00	0.21
91	000708	中信特钢	429,000	5,821,530.00	0.21
92	600660	福耀玻璃	118,930	5,696,747.00	0.20
93	600667	太极实业	982,900	5,612,359.00	0.20
94	688036	传音控股	72,754	5,568,591.16	0.20
95	000810	创维数字	640,900	5,498,922.00	0.19
96	603118	共进股份	816,400	5,469,880.00	0.19
97	300190	维尔利	1,979,700	5,444,175.00	0.19
98	688798	艾为电子	95,448	5,404,265.76	0.19
99	688057	金达莱	550,734	5,402,700.54	0.19
100	605589	圣泉集团	266,100	5,399,169.00	0.19
101	688153	唯捷创芯	143,620	5,313,940.00	0.19
102	002745	木林森	658,400	5,306,704.00	0.19
103	002001	新和成	271,400	5,210,880.00	0.18
104	002354	天娱数科	1,742,500	5,210,075.00	0.18
105	300136	信维通信	264,800	5,184,784.00	0.18

106	002110	三钢闽光	1,735,600	5,120,020.00	0.18
107	601969	海南矿业	803,200	5,092,288.00	0.18
108	300366	创意信息	693,900	5,023,836.00	0.18
109	600588	用友网络	499,900	4,999,000.00	0.18
110	603583	捷昌驱动	244,700	4,986,986.00	0.18
111	601211	国泰君安	368,000	4,986,400.00	0.18
112	600075	新疆天业	1,442,936	4,978,129.20	0.18
113	600562	国睿科技	354,200	4,838,372.00	0.17
114	002212	天融信	990,900	4,825,683.00	0.17
115	300303	聚飞光电	989,800	4,810,428.00	0.17
116	603898	好莱客	651,600	4,789,260.00	0.17
117	001218	丽臣实业	318,800	4,772,436.00	0.17
118	600810	神马股份	750,113	4,650,700.60	0.16
119	300223	北京君正	83,642	4,637,112.48	0.16
120	600150	中国船舶	113,200	4,608,372.00	0.16
121	300212	易华录	273,200	4,597,956.00	0.16
122	600741	华域汽车	278,400	4,560,192.00	0.16
123	601717	郑煤机	307,800	4,555,440.00	0.16
124	605066	天正电气	815,750	4,543,727.50	0.16
125	600927	永安期货	405,400	4,520,210.00	0.16
126	688187	时代电气	89,776	4,433,138.88	0.16
127	002139	拓邦股份	414,400	4,400,928.00	0.16
128	002479	富春环保	1,240,200	4,365,504.00	0.15
129	600295	鄂尔多斯	437,300	4,338,016.00	0.15
130	603385	惠达卫浴	768,900	4,221,261.00	0.15
131	300628	亿联网络	113,600	4,177,072.00	0.15
132	300113	顺网科技	407,800	4,175,872.00	0.15
133	301316	慧博云通	283,400	4,160,312.00	0.15
134	688367	工大高科	340,996	4,160,151.20	0.15
135	002249	大洋电机	877,100	4,148,683.00	0.15
136	002402	和而泰	387,100	4,145,841.00	0.15
137	688098	申联生物	980,423	4,088,363.91	0.14
138	600366	宁波韵升	779,000	4,066,380.00	0.14
139	601101	昊华能源	441,600	4,058,304.00	0.14
140	603212	赛伍技术	364,600	4,025,184.00	0.14
141	600745	闻泰科技	142,100	4,014,325.00	0.14
142	600000	浦发银行	485,273	3,993,796.79	0.14
143	002913	奥士康	148,200	3,973,242.00	0.14
144	688388	嘉元科技	407,510	3,973,222.50	0.14
145	300079	数码视讯	978,000	3,970,680.00	0.14
146	601311	骆驼股份	493,300	3,956,266.00	0.14
147	002683	广东宏大	195,900	3,943,467.00	0.14
148	002318	久立特材	168,700	3,935,771.00	0.14

149	301205	联特科技	62,600	3,928,150.00	0.14
150	002416	爱施德	443,800	3,927,630.00	0.14
151	603993	洛阳钼业	461,900	3,926,150.00	0.14
152	300296	利亚德	870,200	3,915,900.00	0.14
153	600674	川投能源	208,700	3,913,125.00	0.14
154	300166	东方国信	623,700	3,817,044.00	0.13
155	600552	凯盛科技	404,400	3,813,492.00	0.13
156	600618	氯碱化工	432,500	3,797,350.00	0.13
157	300846	首都在线	402,200	3,764,592.00	0.13
158	300323	华灿光电	857,000	3,727,950.00	0.13
159	600316	洪都航空	223,900	3,723,457.00	0.13
160	300085	银之杰	454,000	3,668,320.00	0.13
161	000596	古井贡酒	17,300	3,651,511.00	0.13
162	688095	福昕软件	79,676	3,649,957.56	0.13
163	600399	抚顺特钢	646,900	3,642,047.00	0.13
164	300679	电连技术	90,300	3,632,769.00	0.13
165	603010	万盛股份	402,980	3,630,849.80	0.13
166	603918	金桥信息	347,100	3,627,195.00	0.13
167	002414	高德红外	613,100	3,611,159.00	0.13
168	603185	弘元绿能	211,100	3,607,699.00	0.13
169	600036	招商银行	105,500	3,607,045.00	0.13
170	603041	美思德	359,600	3,596,000.00	0.13
171	601222	林洋能源	563,300	3,531,891.00	0.12
172	300456	赛微电子	222,300	3,527,901.00	0.12
173	600703	三安光电	299,100	3,505,452.00	0.12
174	300866	安克创新	48,500	3,453,685.00	0.12
175	601212	白银有色	1,241,900	3,452,482.00	0.12
176	300188	国投智能	310,300	3,447,433.00	0.12
177	002453	华软科技	801,900	3,440,151.00	0.12
178	000902	新洋丰	289,100	3,431,617.00	0.12
179	300747	锐科激光	192,900	3,423,975.00	0.12
180	600835	上海机电	297,000	3,418,470.00	0.12
181	002008	大族激光	164,100	3,413,280.00	0.12
182	300608	思特奇	379,000	3,403,420.00	0.12
183	688158	优刻得	332,612	3,402,620.76	0.12
184	603629	利通电子	184,300	3,402,178.00	0.12
185	600850	电科数字	187,200	3,388,320.00	0.12
186	300077	国民技术	387,100	3,379,383.00	0.12
187	300369	绿盟科技	661,300	3,379,243.00	0.12
188	000723	美锦能源	709,800	3,378,648.00	0.12
189	601288	农业银行	769,000	3,352,840.00	0.12
190	300428	立中集团	178,500	3,318,315.00	0.12
191	000923	河钢资源	192,600	3,316,572.00	0.12

192	603017	中衡设计	369,800	3,276,428.00	0.12
193	002171	楚江新材	494,100	3,256,119.00	0.12
194	300331	苏大维格	200,700	3,227,256.00	0.11
195	300674	宇信科技	290,800	3,222,064.00	0.11
196	600100	同方股份	629,500	3,204,155.00	0.11
197	600997	开滦股份	466,600	3,200,876.00	0.11
198	002064	华峰化学	445,200	3,192,084.00	0.11
199	300432	富临精工	491,600	3,165,904.00	0.11
200	600673	东阳光	448,800	3,159,552.00	0.11
201	600610	中毅达	793,300	3,157,334.00	0.11
202	300377	赢时胜	620,200	3,150,616.00	0.11
203	600299	安迪苏	324,600	3,148,620.00	0.11
204	688311	盟升电子	153,212	3,139,313.88	0.11
205	600330	天通股份	457,100	3,108,280.00	0.11
206	300825	阿尔特	320,000	3,100,800.00	0.11
207	603989	艾华集团	220,000	3,093,200.00	0.11
208	002056	横店东磁	245,700	3,063,879.00	0.11
209	600877	电科芯片	285,700	3,062,704.00	0.11
210	603037	凯众股份	234,920	3,051,610.80	0.11
211	300766	每日互动	308,400	3,050,076.00	0.11
212	600356	恒丰纸业	514,692	3,046,976.64	0.11
213	600143	金发科技	457,800	3,026,058.00	0.11
214	688127	蓝特光学	163,623	3,009,026.97	0.11
215	688031	星环科技	81,885	3,005,998.35	0.11
216	688586	江航装备	320,025	2,976,232.50	0.11
217	603466	风语筑	345,700	2,952,278.00	0.10
218	600640	国脉文化	285,200	2,951,820.00	0.10
219	002852	道道全	406,200	2,924,640.00	0.10
220	002777	久远银海	195,100	2,924,549.00	0.10
221	600309	万华化学	35,900	2,902,874.00	0.10
222	600237	铜峰电子	553,300	2,888,226.00	0.10
223	600350	山东高速	324,740	2,873,949.00	0.10
224	002174	游族网络	375,000	2,846,250.00	0.10
225	600770	综艺股份	1,241,200	2,842,348.00	0.10
226	600508	上海能源	200,400	2,835,660.00	0.10
227	002786	银宝山新	352,800	2,829,456.00	0.10
228	601989	中国重工	571,600	2,817,988.00	0.10
229	600126	杭钢股份	685,200	2,816,172.00	0.10
230	600177	雅戈尔	395,500	2,815,960.00	0.10
231	002145	中核钛白	858,000	2,814,240.00	0.10
232	300559	佳发教育	293,800	2,811,666.00	0.10
233	600668	尖峰集团	350,600	2,787,270.00	0.10
234	600699	均胜电子	187,100	2,772,822.00	0.10

235	688400	凌云光	165,634	2,762,775.12	0.10
236	600449	宁夏建材	233,800	2,747,150.00	0.10
237	600893	航发动力	74,200	2,712,010.00	0.10
238	601003	柳钢股份	1,061,336	2,685,180.08	0.09
239	600409	三友化工	530,600	2,663,612.00	0.09
240	002054	德美化工	542,400	2,663,184.00	0.09
241	300271	华宇软件	568,600	2,661,048.00	0.09
242	603960	克来机电	126,100	2,660,710.00	0.09
243	300232	洲明科技	509,200	2,658,024.00	0.09
244	601869	长飞光纤	109,200	2,656,836.00	0.09
245	000062	深圳华强	294,045	2,617,000.50	0.09
246	002549	凯美特气	511,400	2,613,254.00	0.09
247	600392	盛和资源	302,700	2,609,274.00	0.09
248	600410	华胜天成	674,200	2,609,154.00	0.09
249	601828	美凯龙	1,019,850	2,600,617.50	0.09
250	300183	东软载波	223,300	2,585,814.00	0.09
251	300123	亚光科技	555,096	2,575,645.44	0.09
252	600971	恒源煤电	215,500	2,573,070.00	0.09
253	603189	网达软件	232,300	2,541,362.00	0.09
254	688733	壹石通	169,846	2,539,197.70	0.09
255	002595	豪迈科技	65,600	2,503,952.00	0.09
256	300599	雄塑科技	502,096	2,495,417.12	0.09
257	688590	新致软件	192,057	2,477,535.30	0.09
258	601015	陕西黑猫	884,800	2,477,440.00	0.09
259	002283	天润工业	577,200	2,476,188.00	0.09
260	000825	太钢不锈	732,400	2,475,512.00	0.09
261	601298	青岛港	258,700	2,473,172.00	0.09
262	002649	博彦科技	309,549	2,464,010.04	0.09
263	002467	二六三	737,400	2,462,916.00	0.09
264	688292	浩瀚深度	158,497	2,450,363.62	0.09
265	300654	世纪天鸿	287,163	2,440,885.50	0.09
266	688106	金宏气体	139,163	2,438,135.76	0.09
267	300397	天和防务	263,400	2,423,280.00	0.09
268	605189	富春染织	227,220	2,422,165.20	0.09
269	603666	亿嘉和	152,800	2,411,184.00	0.09
270	300328	宜安科技	563,300	2,410,924.00	0.09
271	600886	国投电力	131,100	2,391,264.00	0.08
272	002362	汉王科技	143,600	2,390,940.00	0.08
273	688234	天岳先进	50,928	2,389,541.76	0.08
274	301318	维海德	86,900	2,387,143.00	0.08
275	300382	斯莱克	402,400	2,378,184.00	0.08
276	002657	中科金财	208,200	2,365,152.00	0.08
277	601009	南京银行	227,500	2,363,725.00	0.08

278	600577	精达股份	591,600	2,348,652.00	0.08
279	000681	视觉中国	203,300	2,337,950.00	0.08
280	603115	海星股份	224,500	2,334,800.00	0.08
281	688199	久日新材	174,173	2,333,918.20	0.08
282	600990	四创电子	132,800	2,330,640.00	0.08
283	688011	新光光电	153,764	2,329,524.60	0.08
284	688711	宏微科技	144,696	2,323,817.76	0.08
285	603585	苏利股份	236,780	2,310,972.80	0.08
286	600372	中航机载	192,800	2,307,816.00	0.08
287	002465	海格通信	222,400	2,304,064.00	0.08
288	688680	海优新材	80,068	2,301,154.32	0.08
289	002488	金固股份	523,300	2,297,287.00	0.08
290	002545	东方铁塔	337,100	2,295,651.00	0.08
291	603626	科森科技	411,700	2,289,052.00	0.08
292	600391	航发科技	150,100	2,289,025.00	0.08
293	600970	中材国际	189,200	2,281,752.00	0.08
294	600363	联创光电	82,800	2,278,656.00	0.08
295	601187	厦门银行	426,900	2,275,377.00	0.08
296	600051	宁波联合	430,258	2,267,459.66	0.08
297	603677	奇精机械	194,500	2,265,925.00	0.08
298	688800	瑞可达	80,631	2,264,118.48	0.08
299	603138	海量数据	215,000	2,253,200.00	0.08
300	300741	华宝股份	147,600	2,249,424.00	0.08
301	603527	众源新材	316,500	2,247,150.00	0.08
302	603015	弘讯科技	296,400	2,240,784.00	0.08
303	002978	安宁股份	80,400	2,239,944.00	0.08
304	002391	长青股份	494,800	2,236,496.00	0.08
305	300045	华力创通	125,400	2,213,310.00	0.08
306	603348	文灿股份	79,900	2,212,431.00	0.08
307	000338	潍柴动力	135,100	2,194,024.00	0.08
308	603915	国茂股份	211,100	2,172,219.00	0.08
309	600490	鹏欣资源	831,500	2,161,900.00	0.08
310	688152	麒麟信安	55,795	2,160,382.40	0.08
311	300322	硕贝德	254,200	2,130,196.00	0.08
312	603938	三孚股份	181,100	2,127,925.00	0.08
313	002527	新时达	353,800	2,119,262.00	0.07
314	600797	浙大网新	457,600	2,118,688.00	0.07
315	301308	江波龙	22,300	2,112,702.00	0.07
316	688001	华兴源创	93,463	2,110,394.54	0.07
317	600801	华新水泥	153,300	2,107,875.00	0.07
318	000157	中联重科	274,000	2,104,320.00	0.07
319	603906	龙蟠科技	269,900	2,102,521.00	0.07
320	002845	同兴达	158,712	2,098,172.64	0.07

321	002735	王子新材	212,400	2,087,892.00	0.07
322	605259	绿田机械	106,960	2,086,789.60	0.07
323	603123	翠微股份	350,500	2,081,970.00	0.07
324	600569	安阳钢铁	1,449,913	2,073,375.59	0.07
325	601963	重庆银行	267,400	2,072,350.00	0.07
326	600732	爱旭股份	228,600	2,068,830.00	0.07
327	002274	华昌化工	278,800	2,068,696.00	0.07
328	300168	万达信息	435,300	2,067,675.00	0.07
329	300805	电声股份	324,200	2,061,912.00	0.07
330	300659	中孚信息	158,900	2,060,933.00	0.07
331	002101	广东鸿图	195,450	2,058,088.50	0.07
332	603881	数据港	161,330	2,050,504.30	0.07
333	002009	天奇股份	180,100	2,042,334.00	0.07
334	601601	中国太保	73,000	2,033,780.00	0.07
335	603297	永新光学	33,500	2,026,415.00	0.07
336	300047	天源迪科	307,000	2,007,780.00	0.07
337	600602	云赛智联	181,200	2,000,448.00	0.07
338	600728	佳都科技	536,800	1,991,528.00	0.07
339	002553	南方精工	213,900	1,982,853.00	0.07
340	603233	大参林	138,123	1,975,158.90	0.07
341	603887	城地香江	377,900	1,968,859.00	0.07
342	601218	吉鑫科技	702,700	1,960,533.00	0.07
343	688365	光云科技	322,069	1,938,855.38	0.07
344	603026	石大胜华	57,300	1,936,740.00	0.07
345	300134	大富科技	283,700	1,934,834.00	0.07
346	688616	西力科技	170,458	1,932,993.72	0.07
347	603266	天龙股份	114,100	1,930,572.00	0.07
348	002004	华邦健康	508,000	1,930,400.00	0.07
349	603511	爱慕股份	155,600	1,910,768.00	0.07
350	600130	波导股份	595,300	1,899,007.00	0.07
351	688370	丛麟科技	118,965	1,898,681.40	0.07
352	300375	鹏翎股份	490,100	1,896,687.00	0.07
353	688297	中无人机	57,388	1,895,525.64	0.07
354	603110	东方材料	170,100	1,893,213.00	0.07
355	603609	禾丰股份	289,400	1,892,676.00	0.07
356	605333	沪光股份	67,900	1,891,015.00	0.07
357	600206	有研新材	212,400	1,890,360.00	0.07
358	688023	安恒信息	47,234	1,889,832.34	0.07
359	600382	广东明珠	472,500	1,885,275.00	0.07
360	300687	赛意信息	135,100	1,880,592.00	0.07
361	601886	江河集团	384,300	1,875,384.00	0.07
362	603636	南威软件	243,300	1,873,410.00	0.07
363	603995	甬金股份	106,100	1,858,872.00	0.07

364	002191	劲嘉股份	514,400	1,856,984.00	0.07
365	001203	大中矿业	192,800	1,852,808.00	0.07
366	688588	凌志软件	268,955	1,842,341.75	0.07
367	300349	金卡智能	154,100	1,836,872.00	0.06
368	603380	易德龙	91,200	1,831,296.00	0.06
369	003015	日久光电	199,700	1,813,276.00	0.06
370	603637	镇海股份	297,200	1,812,920.00	0.06
371	603728	鸣志电器	45,000	1,810,350.00	0.06
372	300170	汉得信息	294,200	1,806,388.00	0.06
373	600519	贵州茅台	1,230	1,804,889.70	0.06
374	301185	鸥玛软件	125,700	1,801,281.00	0.06
375	601038	一拖股份	113,700	1,797,597.00	0.06
376	002446	盛路通信	317,200	1,792,180.00	0.06
377	688309	恒誉环保	149,461	1,792,037.39	0.06
378	603098	森特股份	226,000	1,776,360.00	0.06
379	603556	海兴电力	37,900	1,774,857.00	0.06
380	002955	鸿合科技	75,400	1,762,852.00	0.06
381	300768	迪普科技	148,600	1,760,910.00	0.06
382	688339	亿华通	58,620	1,757,427.60	0.06
383	300553	集智股份	71,700	1,755,933.00	0.06
384	603121	华培动力	245,700	1,749,384.00	0.06
385	688169	石头科技	4,453	1,748,247.80	0.06
386	300182	捷成股份	470,100	1,744,071.00	0.06
387	688133	泰坦科技	110,070	1,736,904.60	0.06
388	002010	传化智联	451,000	1,731,840.00	0.06
389	002990	盛视科技	85,900	1,729,167.00	0.06
390	600110	诺德股份	559,200	1,705,560.00	0.06
391	002585	双星新材	343,700	1,704,752.00	0.06
392	300420	五洋自控	774,400	1,695,936.00	0.06
393	600008	首创环保	632,500	1,695,100.00	0.06
394	603569	长久物流	246,400	1,690,304.00	0.06
395	301069	凯盛新材	128,500	1,684,635.00	0.06
396	300099	尤洛卡	370,500	1,682,070.00	0.06
397	600851	海欣股份	368,000	1,681,760.00	0.06
398	300642	透景生命	143,500	1,670,340.00	0.06
399	603660	苏州科达	305,700	1,669,122.00	0.06
400	300821	东岳硅材	244,000	1,668,960.00	0.06
401	603598	引力传媒	131,000	1,666,320.00	0.06
402	688707	振华新材	170,634	1,661,975.16	0.06
403	002376	新北洋	308,300	1,661,737.00	0.06
404	603662	柯力传感	71,175	1,661,224.50	0.06
405	601949	中国出版	280,300	1,656,573.00	0.06
406	688071	华依科技	76,067	1,648,371.89	0.06

407	688391	钜泉科技	56,371	1,644,342.07	0.06
408	000020	深华发 A	166,000	1,643,400.00	0.06
409	300035	中科电气	192,700	1,639,877.00	0.06
410	688372	伟测科技	41,682	1,639,353.06	0.06
411	601369	陕鼓动力	203,866	1,635,005.32	0.06
412	603102	百合股份	54,300	1,634,973.00	0.06
413	688163	赛伦生物	134,552	1,633,461.28	0.06
414	688567	孚能科技	170,090	1,632,864.00	0.06
415	301006	迈拓股份	139,600	1,631,924.00	0.06
416	002474	榕基软件	374,200	1,631,512.00	0.06
417	300032	金龙机电	522,300	1,624,353.00	0.06
418	600510	黑牡丹	435,300	1,619,316.00	0.06
419	603323	苏农银行	335,300	1,612,793.00	0.06
420	002558	巨人网络	170,800	1,612,352.00	0.06
421	300226	上海钢联	95,100	1,610,994.00	0.06
422	603232	格尔软件	154,600	1,610,932.00	0.06
423	300798	锦鸡股份	258,900	1,607,769.00	0.06
424	002439	启明星辰	93,000	1,605,180.00	0.06
425	000960	锡业股份	103,100	1,597,019.00	0.06
426	688172	燕东微	98,501	1,593,746.18	0.06
427	603489	八方股份	59,000	1,591,820.00	0.06
428	301169	零点有数	55,200	1,589,760.00	0.06
429	600151	航天机电	351,700	1,589,684.00	0.06
430	600960	渤海汽车	589,900	1,569,134.00	0.06
431	600999	招商证券	112,800	1,569,048.00	0.06
432	002068	黑猫股份	220,900	1,568,390.00	0.06
433	601908	京运通	618,800	1,565,564.00	0.06
434	688579	山大地纬	199,017	1,562,283.45	0.06
435	688159	有方科技	41,257	1,561,990.02	0.06
436	603051	鹿山新材	71,400	1,558,662.00	0.06
437	600820	隧道股份	238,400	1,556,752.00	0.06
438	301159	三维天地	58,300	1,554,861.00	0.05
439	688718	唯赛勃	180,844	1,546,216.20	0.05
440	000030	富奥股份	314,500	1,544,195.00	0.05
441	300227	光韵达	282,100	1,543,087.00	0.05
442	002866	传艺科技	119,300	1,535,391.00	0.05
443	603166	福达股份	313,300	1,535,170.00	0.05
444	300771	智莱科技	174,600	1,534,734.00	0.05
445	605136	丽人丽妆	278,400	1,533,984.00	0.05
446	002429	兆驰股份	318,600	1,532,466.00	0.05
447	605208	永茂泰	245,200	1,527,596.00	0.05
448	300279	和晶科技	365,700	1,524,969.00	0.05
449	600563	法拉电子	20,000	1,523,600.00	0.05

450	300640	德艺文创	384,300	1,514,142.00	0.05
451	002952	亚世光电	73,200	1,504,260.00	0.05
452	300383	光环新网	177,300	1,498,185.00	0.05
453	002705	新宝股份	106,300	1,495,641.00	0.05
454	002979	雷赛智能	81,800	1,488,760.00	0.05
455	301007	德迈仕	127,400	1,488,032.00	0.05
456	603218	日月股份	144,700	1,486,069.00	0.05
457	603618	杭电股份	339,100	1,485,258.00	0.05
458	301326	捷邦科技	45,600	1,483,824.00	0.05
459	603806	福斯特	100,880	1,482,936.00	0.05
460	600841	动力新科	452,112	1,482,927.36	0.05
461	605006	山东玻纤	336,244	1,482,836.04	0.05
462	688080	映翰通	48,679	1,476,434.07	0.05
463	603013	亚普股份	109,200	1,470,924.00	0.05
464	002091	江苏国泰	215,400	1,466,874.00	0.05
465	600152	维科技术	303,700	1,457,760.00	0.05
466	002406	远东传动	295,600	1,457,308.00	0.05
467	002153	石基信息	254,000	1,455,420.00	0.05
468	688207	格灵深瞳	126,758	1,453,914.26	0.05
469	600512	腾达建设	767,700	1,450,953.00	0.05
470	002514	宝馨科技	350,900	1,449,217.00	0.05
471	605228	神通科技	168,800	1,448,304.00	0.05
472	002498	汉缆股份	440,100	1,447,929.00	0.05
473	688395	正弦电气	101,526	1,446,745.50	0.05
474	688070	纵横股份	51,167	1,445,979.42	0.05
475	300556	丝路视觉	86,300	1,443,799.00	0.05
476	000503	国新健康	215,615	1,438,152.05	0.05
477	600063	皖维高新	408,500	1,437,920.00	0.05
478	000536	华映科技	709,200	1,432,584.00	0.05
479	300603	立昂技术	207,200	1,431,752.00	0.05
480	601002	晋亿实业	492,916	1,429,456.40	0.05
481	600511	国药股份	46,400	1,428,656.00	0.05
482	600500	中化国际	407,500	1,422,175.00	0.05
483	301218	华是科技	68,600	1,420,706.00	0.05
484	603333	尚纬股份	456,700	1,420,337.00	0.05
485	603577	汇金通	204,300	1,417,842.00	0.05
486	688013	天臣医疗	94,924	1,408,672.16	0.05
487	002093	国脉科技	231,500	1,405,205.00	0.05
488	603681	永冠新材	109,800	1,399,950.00	0.05
489	002123	梦网科技	198,800	1,397,564.00	0.05
490	603321	梅轮电梯	204,200	1,394,686.00	0.05
491	300173	福能东方	369,800	1,394,146.00	0.05
492	002132	恒星科技	654,300	1,387,116.00	0.05

493	605218	伟时电子	85,600	1,382,440.00	0.05
494	000703	恒逸石化	193,500	1,371,915.00	0.05
495	603095	越剑智能	104,200	1,366,062.00	0.05
496	600925	苏能股份	269,800	1,362,490.00	0.05
497	688028	沃尔德	82,813	1,360,617.59	0.05
498	002017	东信和平	163,000	1,357,790.00	0.05
499	300319	麦捷科技	145,400	1,356,582.00	0.05
500	002449	国星光电	190,300	1,354,936.00	0.05
501	601058	赛轮轮胎	96,700	1,353,800.00	0.05
502	605500	森林包装	218,903	1,346,253.45	0.05
503	600873	梅花生物	134,200	1,344,684.00	0.05
504	002662	京威股份	441,900	1,343,376.00	0.05
505	000016	深康佳 A	630,500	1,342,965.00	0.05
506	300838	浙江力诺	130,600	1,342,568.00	0.05
507	601069	西部黄金	115,000	1,337,450.00	0.05
508	600956	新天绿能	163,700	1,337,429.00	0.05
509	603106	恒银科技	313,800	1,336,788.00	0.05
510	300441	鲍斯股份	223,900	1,327,727.00	0.05
511	300291	百纳千成	311,600	1,327,416.00	0.05
512	603187	海容冷链	113,600	1,324,576.00	0.05
513	001270	铖昌科技	35,900	1,318,248.00	0.05
514	300571	平治信息	62,900	1,317,126.00	0.05
515	603798	康普顿	156,100	1,314,362.00	0.05
516	002516	旷达科技	360,200	1,311,128.00	0.05
517	000969	安泰科技	164,500	1,304,485.00	0.05
518	688337	普源精电	51,554	1,300,191.88	0.05
519	002539	云图控股	181,800	1,296,234.00	0.05
520	600135	乐凯胶片	265,500	1,295,640.00	0.05
521	603221	爱丽家居	145,700	1,292,359.00	0.05
522	603982	泉峰汽车	161,400	1,291,200.00	0.05
523	300625	三雄极光	122,900	1,289,221.00	0.05
524	301067	显盈科技	65,400	1,289,034.00	0.05
525	603089	正裕工业	153,850	1,286,186.00	0.05
526	603006	联明股份	131,800	1,282,414.00	0.05
527	003022	联泓新科	93,400	1,280,514.00	0.05
528	300130	新国都	76,500	1,272,960.00	0.05
529	600012	皖通高速	91,000	1,271,270.00	0.04
530	300248	新开普	195,700	1,270,093.00	0.04
531	688181	八亿时空	66,958	1,268,854.10	0.04
532	300921	南凌科技	73,200	1,267,824.00	0.04
533	301262	海看股份	55,900	1,260,545.00	0.04
534	600775	南京熊猫	157,500	1,260,000.00	0.04
535	601528	瑞丰银行	266,400	1,257,408.00	0.04

536	603768	常青股份	110,600	1,254,204.00	0.04
537	603958	哈森股份	153,400	1,253,278.00	0.04
538	002369	卓翼科技	338,100	1,247,589.00	0.04
539	688215	瑞晟智能	52,868	1,247,156.12	0.04
540	688238	和元生物	265,234	1,228,033.42	0.04
541	300884	狄耐克	142,400	1,227,488.00	0.04
542	002148	北纬科技	263,600	1,225,740.00	0.04
543	688039	当虹科技	47,500	1,225,025.00	0.04
544	605289	罗曼股份	48,200	1,224,280.00	0.04
545	601616	广电电气	419,000	1,219,290.00	0.04
546	301321	翰博高新	105,800	1,217,758.00	0.04
547	300620	光库科技	33,100	1,217,418.00	0.04
548	605222	起帆电缆	79,300	1,216,462.00	0.04
549	688178	万德斯	117,802	1,214,538.62	0.04
550	300660	江苏雷利	47,500	1,212,200.00	0.04
551	603937	丽岛新材	156,000	1,210,560.00	0.04
552	002933	新兴装备	52,800	1,209,648.00	0.04
553	600460	士兰微	68,700	1,202,937.00	0.04
554	600184	光电股份	140,900	1,199,059.00	0.04
555	000727	冠捷科技	581,500	1,197,890.00	0.04
556	000910	大亚圣象	194,700	1,195,458.00	0.04
557	603025	大豪科技	86,500	1,195,430.00	0.04
558	300978	东箭科技	129,500	1,195,285.00	0.04
559	600186	莲花控股	348,400	1,195,012.00	0.04
560	600386	北巴传媒	427,300	1,192,167.00	0.04
561	300560	中富通	110,000	1,190,200.00	0.04
562	300652	雷迪克	59,800	1,185,834.00	0.04
563	601388	怡球资源	538,500	1,179,315.00	0.04
564	002998	优彩资源	207,700	1,177,659.00	0.04
565	002026	山东威达	141,800	1,176,940.00	0.04
566	300011	鼎汉技术	235,500	1,175,145.00	0.04
567	002995	天地在线	89,000	1,174,800.00	0.04
568	688776	国光电气	21,151	1,171,765.40	0.04
569	002666	德联集团	322,600	1,167,812.00	0.04
570	688330	宏力达	56,820	1,158,559.80	0.04
571	300074	华平股份	352,300	1,152,021.00	0.04
572	600606	绿地控股	850,400	1,148,040.00	0.04
573	603206	嘉环科技	90,800	1,146,804.00	0.04
574	688205	德科立	39,679	1,143,151.99	0.04
575	605398	新炬网络	55,700	1,141,293.00	0.04
576	002347	泰尔股份	302,700	1,141,179.00	0.04
577	300276	三丰智能	323,800	1,139,776.00	0.04
578	300065	海兰信	172,400	1,139,564.00	0.04

579	002855	捷荣技术	54,100	1,137,182.00	0.04
580	300473	德尔股份	82,800	1,126,908.00	0.04
581	000510	新金路	402,700	1,115,479.00	0.04
582	002108	沧州明珠	363,600	1,112,616.00	0.04
583	688110	东芯股份	58,185	1,109,587.95	0.04
584	003005	竞业达	53,200	1,108,688.00	0.04
585	002636	金安国纪	173,700	1,102,995.00	0.04
586	603926	铁流股份	132,500	1,099,750.00	0.04
587	601872	招商轮船	130,000	1,098,500.00	0.04
588	605338	巴比食品	82,700	1,095,775.00	0.04
589	300259	新天科技	429,220	1,085,926.60	0.04
590	603987	康德莱	177,300	1,083,303.00	0.04
591	603158	腾龙股份	153,800	1,082,752.00	0.04
592	300252	金信诺	172,600	1,078,750.00	0.04
593	002931	锋龙股份	105,000	1,069,950.00	0.04
594	601996	丰林集团	632,300	1,068,587.00	0.04
595	603980	吉华集团	285,700	1,068,518.00	0.04
596	002184	海得控制	118,600	1,065,028.00	0.04
597	600167	联美控股	203,551	1,060,500.71	0.04
598	688055	龙腾光电	333,894	1,058,443.98	0.04
599	600433	冠豪高新	398,830	1,056,899.50	0.04
600	603071	物产环能	84,300	1,056,279.00	0.04
601	300024	机器人	108,400	1,055,816.00	0.04
602	300522	世名科技	95,200	1,051,960.00	0.04
603	603214	爱婴室	93,140	1,051,550.60	0.04
604	688257	新锐股份	68,441	1,049,200.53	0.04
605	600800	渤海化学	526,889	1,048,509.11	0.04
606	603949	雪龙集团	93,100	1,048,306.00	0.04
607	603211	晋拓股份	76,400	1,047,444.00	0.04
608	688065	凯赛生物	23,047	1,046,103.33	0.04
609	001319	铭科精技	63,700	1,038,310.00	0.04
610	600228	返利科技	213,600	1,038,096.00	0.04
611	688669	聚石化学	91,686	1,037,885.52	0.04
612	603315	福鞍股份	108,600	1,036,044.00	0.04
613	002957	科瑞技术	76,400	1,035,984.00	0.04
614	600420	国药现代	96,700	1,032,756.00	0.04
615	688737	中自科技	63,587	1,030,109.40	0.04
616	002988	豪美新材	66,800	1,025,380.00	0.04
617	600691	阳煤化工	599,600	1,025,316.00	0.04
618	002597	金禾实业	51,500	1,024,335.00	0.04
619	603819	神力股份	97,100	1,019,550.00	0.04
620	605555	德昌股份	54,500	1,014,245.00	0.04
621	603167	渤海轮渡	123,700	1,010,629.00	0.04

622	688335	复洁环保	123,619	1,007,494.85	0.04
623	600643	爱建集团	267,101	1,006,970.77	0.04
624	688379	华光新材	73,314	1,005,134.94	0.04
625	600218	全柴动力	149,700	1,004,487.00	0.04
626	688608	恒玄科技	6,860	1,004,166.80	0.04
627	300979	华利集团	16,500	1,004,025.00	0.04
628	300230	永利股份	298,465	1,002,842.40	0.04
629	300348	长亮科技	146,500	999,130.00	0.04
630	603615	茶花股份	94,700	997,191.00	0.04
631	603758	秦安股份	131,200	997,120.00	0.04
632	600928	西安银行	304,200	994,734.00	0.04
633	603969	银龙股份	199,500	989,520.00	0.03
634	600323	瀚蓝环境	47,300	988,570.00	0.03
635	605376	博迁新材	43,600	984,052.00	0.03
636	601677	明泰铝业	85,000	982,600.00	0.03
637	603096	新经典	57,700	975,130.00	0.03
638	600888	新疆众和	137,700	973,539.00	0.03
639	002190	成飞集成	68,600	968,632.00	0.03
640	600802	福建水泥	348,400	968,552.00	0.03
641	600053	九鼎投资	69,800	968,126.00	0.03
642	301396	宏景科技	49,600	967,696.00	0.03
643	001278	一彬科技	61,100	965,991.00	0.03
644	600288	大恒科技	148,100	964,131.00	0.03
645	002531	天顺风能	107,500	961,050.00	0.03
646	301055	张小泉	81,000	960,660.00	0.03
647	300949	奥雅股份	32,200	959,882.00	0.03
648	300508	维宏股份	49,300	957,899.00	0.03
649	600073	光明肉业	173,700	957,087.00	0.03
650	688179	阿拉丁	98,562	953,094.54	0.03
651	600681	百川能源	282,800	953,036.00	0.03
652	300001	特锐德	47,300	951,676.00	0.03
653	600468	百利电气	219,800	947,338.00	0.03
654	300466	赛摩智能	154,200	945,246.00	0.03
655	300055	万邦达	233,200	944,460.00	0.03
656	000550	江铃汽车	43,500	944,385.00	0.03
657	603032	德新科技	82,600	944,118.00	0.03
658	603155	新亚强	86,060	943,217.60	0.03
659	603727	博迈科	71,600	942,256.00	0.03
660	300701	森霸传感	112,000	941,920.00	0.03
661	603038	华立股份	128,500	939,335.00	0.03
662	000837	秦川机床	127,600	939,136.00	0.03
663	002512	达华智能	272,000	938,400.00	0.03
664	688033	天宜上佳	156,008	936,048.00	0.03

665	605255	天普股份	77,800	935,156.00	0.03
666	300414	中光防雷	141,100	932,671.00	0.03
667	301138	华研精机	38,900	929,321.00	0.03
668	603988	中电电机	118,800	927,828.00	0.03
669	605050	福然德	105,300	927,693.00	0.03
670	002993	奥海科技	24,900	926,280.00	0.03
671	603156	养元饮品	43,500	925,245.00	0.03
672	688739	成大生物	38,150	924,756.00	0.03
673	002434	万里扬	188,400	923,160.00	0.03
674	300615	欣天科技	96,300	921,591.00	0.03
675	002441	众业达	121,500	920,970.00	0.03
676	603396	金辰股份	28,300	918,901.00	0.03
677	603028	赛福天	162,100	912,623.00	0.03
678	300380	安硕信息	59,400	912,384.00	0.03
679	300606	金太阳	49,100	911,296.00	0.03
680	688088	虹软科技	31,571	911,139.06	0.03
681	300504	天邑股份	74,700	910,593.00	0.03
682	300132	青松股份	261,600	910,368.00	0.03
683	603225	新凤鸣	58,300	908,897.00	0.03
684	002689	远大智能	423,100	905,434.00	0.03
685	002975	博杰股份	30,300	905,364.00	0.03
686	300877	金春股份	83,400	904,056.00	0.03
687	300810	中科海讯	59,000	903,290.00	0.03
688	603317	天味食品	78,980	901,161.80	0.03
689	605365	立达信	56,700	899,829.00	0.03
690	000712	锦龙股份	119,900	899,250.00	0.03
691	300082	奥克股份	210,700	897,582.00	0.03
692	688007	光峰科技	55,745	897,494.50	0.03
693	300691	联合光电	59,600	896,980.00	0.03
694	603829	洛凯股份	75,600	894,348.00	0.03
695	300387	富邦股份	149,000	892,510.00	0.03
696	603999	读者传媒	188,500	891,605.00	0.03
697	300422	博世科	187,300	891,548.00	0.03
698	603258	电魂网络	55,200	891,480.00	0.03
699	002272	川润股份	198,900	891,072.00	0.03
700	300095	华伍股份	161,500	889,865.00	0.03
701	301020	密封科技	56,000	885,920.00	0.03
702	002164	宁波东力	230,700	885,888.00	0.03
703	300562	乐心医疗	99,400	885,654.00	0.03
704	300385	雪浪环境	262,700	885,299.00	0.03
705	001234	泰慕士	52,100	885,179.00	0.03
706	301209	联合化学	40,400	884,760.00	0.03
707	605288	凯迪股份	28,500	882,360.00	0.03

708	300707	威唐工业	71,200	881,456.00	0.03
709	688511	天微电子	40,457	880,748.89	0.03
710	300899	上海凯鑫	47,400	880,692.00	0.03
711	601398	工商银行	154,501	880,655.70	0.03
712	300912	凯龙高科	93,900	879,843.00	0.03
713	688499	利元亨	45,950	879,023.50	0.03
714	601700	风范股份	200,200	878,878.00	0.03
715	300565	科信技术	87,400	878,370.00	0.03
716	300694	蠡湖股份	103,200	878,232.00	0.03
717	301228	实朴检测	93,800	877,030.00	0.03
718	603683	晶华新材	110,400	876,576.00	0.03
719	688078	龙软科技	38,022	875,646.66	0.03
720	603917	合力科技	80,900	875,338.00	0.03
721	600098	广州发展	136,700	874,880.00	0.03
722	300448	浩云科技	208,800	874,872.00	0.03
723	603956	威派格	164,700	874,557.00	0.03
724	002774	快意电梯	137,600	873,760.00	0.03
725	688173	希荻微	79,203	873,609.09	0.03
726	600735	新华锦	228,000	873,240.00	0.03
727	300665	飞鹿股份	172,200	873,054.00	0.03
728	301313	凡拓数创	42,900	873,015.00	0.03
729	301022	海泰科	44,200	872,950.00	0.03
730	688291	金橙子	50,576	870,918.72	0.03
731	002097	山河智能	144,200	869,526.00	0.03
732	300986	志特新材	128,100	867,237.00	0.03
733	600540	新赛股份	254,300	867,163.00	0.03
734	605118	力鼎光电	58,200	866,598.00	0.03
735	002860	星帅尔	105,600	864,864.00	0.03
736	301510	固高科技	31,100	863,025.00	0.03
737	600648	外高桥	97,400	862,964.00	0.03
738	601208	东材科技	118,600	861,036.00	0.03
739	688528	秦川物联	107,723	860,706.77	0.03
740	002960	青鸟消防	67,400	851,936.00	0.03
741	688228	开普云	22,317	851,616.72	0.03
742	603855	华荣股份	38,500	851,235.00	0.03
743	002863	今飞凯达	208,800	849,816.00	0.03
744	688787	海天瑞声	15,475	849,268.00	0.03
745	605056	咸亨国际	78,600	847,308.00	0.03
746	688262	国芯科技	46,446	845,781.66	0.03
747	603296	华勤技术	15,300	845,019.00	0.03
748	002065	东华软件	186,600	843,432.00	0.03
749	603256	宏和科技	118,900	839,434.00	0.03
750	600756	浪潮软件	83,100	839,310.00	0.03

751	688165	埃夫特	107,280	838,929.60	0.03
752	300605	恒锋信息	92,400	837,144.00	0.03
753	688109	品茗科技	30,561	835,843.35	0.03
754	300790	宇瞳光学	61,700	832,950.00	0.03
755	603790	雅运股份	86,400	829,440.00	0.03
756	603048	浙江黎明	57,100	829,092.00	0.03
757	002169	智光电气	187,900	828,639.00	0.03
758	603196	日播时尚	116,800	824,608.00	0.03
759	300393	中来股份	142,700	823,379.00	0.03
760	603183	建研院	255,880	821,374.80	0.03
761	002189	中光学	58,800	819,672.00	0.03
762	600751	海航科技	368,200	817,404.00	0.03
763	002885	京泉华	75,800	817,124.00	0.03
764	300871	回盛生物	85,200	812,808.00	0.03
765	000639	西王食品	341,000	811,580.00	0.03
766	688357	建龙微纳	34,750	809,675.00	0.03
767	300409	道氏技术	94,200	806,352.00	0.03
768	000599	青岛双星	228,300	805,899.00	0.03
769	688280	精进电动	197,394	803,393.58	0.03
770	600879	航天电子	103,300	802,641.00	0.03
771	688516	奥特维	19,108	798,905.48	0.03
772	300830	金现代	131,200	797,696.00	0.03
773	002912	中新赛克	44,800	793,856.00	0.03
774	688160	步科股份	19,826	792,841.74	0.03
775	603916	苏博特	117,900	791,109.00	0.03
776	300953	震裕科技	14,500	785,900.00	0.03
777	002375	亚厦股份	240,700	782,275.00	0.03
778	603178	圣龙股份	36,500	782,195.00	0.03
779	002075	沙钢股份	207,000	780,390.00	0.03
780	688122	西部超导	20,360	780,195.20	0.03
781	000546	金圆股份	194,100	778,341.00	0.03
782	603656	泰禾智能	71,600	777,576.00	0.03
783	301037	保立佳	87,500	775,250.00	0.03
784	603680	今创集团	117,200	773,520.00	0.03
785	600476	湘邮科技	64,400	772,800.00	0.03
786	688681	科汇股份	74,632	761,992.72	0.03
787	605100	华丰股份	65,500	761,765.00	0.03
788	603336	宏辉果蔬	252,600	760,326.00	0.03
789	002753	永东股份	130,600	758,786.00	0.03
790	605369	拱东医疗	19,000	758,100.00	0.03
791	600207	安彩高科	199,800	757,242.00	0.03
792	600885	宏发股份	27,200	752,896.00	0.03
793	600551	时代出版	105,600	747,648.00	0.03

794	688369	致远互联	47,365	745,051.45	0.03
795	002122	汇洲智能	356,300	744,667.00	0.03
796	300161	华中数控	33,100	744,419.00	0.03
797	600335	国机汽车	128,800	743,176.00	0.03
798	603303	得邦照明	64,600	741,608.00	0.03
799	301028	东亚机械	84,500	741,065.00	0.03
800	688375	国博电子	10,488	740,872.32	0.03
801	603192	汇得科技	54,700	734,621.00	0.03
802	688509	正元地信	254,137	734,455.93	0.03
803	600526	菲达环保	197,100	731,241.00	0.03
804	600860	京城股份	90,500	730,335.00	0.03
805	000626	远大控股	175,600	728,740.00	0.03
806	688186	广大特材	74,630	726,149.90	0.03
807	603301	振德医疗	34,800	725,928.00	0.03
808	600328	中盐化工	105,700	725,102.00	0.03
809	002137	实益达	152,000	723,520.00	0.03
810	603090	宏盛股份	40,500	721,710.00	0.03
811	688788	科思科技	30,676	713,217.00	0.03
812	600539	狮头股份	195,800	712,712.00	0.03
813	603579	荣泰健康	46,020	711,469.20	0.03
814	002520	日发精机	187,600	711,004.00	0.03
815	601860	紫金银行	284,100	710,250.00	0.03
816	603378	亚士创能	140,300	709,918.00	0.03
817	600655	豫园股份	137,700	709,155.00	0.03
818	600523	贵航股份	71,400	706,860.00	0.02
819	002830	名雕股份	71,700	705,528.00	0.02
820	603286	日盈电子	44,200	704,106.00	0.02
821	601137	博威合金	46,200	704,088.00	0.02
822	300241	瑞丰光电	171,700	703,970.00	0.02
823	002224	三力士	182,600	703,010.00	0.02
824	603116	红蜻蜓	156,200	702,900.00	0.02
825	300120	经纬辉开	135,000	700,650.00	0.02
826	300780	德恩精工	51,700	697,433.00	0.02
827	603299	苏盐井神	73,100	694,450.00	0.02
828	002403	爱仕达	104,300	690,466.00	0.02
829	002228	合兴包装	294,900	690,066.00	0.02
830	688561	奇安信	29,195	689,585.90	0.02
831	600698	湖南天雁	203,400	689,526.00	0.02
832	688232	新点软件	34,673	683,751.56	0.02
833	300802	矩子科技	43,300	682,841.00	0.02
834	688551	科威尔	21,673	682,699.50	0.02
835	605122	四方新材	70,160	681,955.20	0.02
836	603238	诺邦股份	68,400	681,264.00	0.02

837	000572	海马汽车	222,400	680,544.00	0.02
838	000058	深赛格	126,600	679,842.00	0.02
839	301330	熵基科技	30,100	676,648.00	0.02
840	600380	健康元	60,400	674,668.00	0.02
841	600215	派斯林	94,500	673,785.00	0.02
842	300384	三联虹普	51,200	671,744.00	0.02
843	603948	建业股份	41,200	670,736.00	0.02
844	603536	惠发食品	84,500	668,395.00	0.02
845	603520	司太立	69,800	665,892.00	0.02
846	300850	新强联	44,200	663,884.00	0.02
847	601011	宝泰隆	414,000	662,400.00	0.02
848	000990	诚志股份	88,900	661,416.00	0.02
849	300148	天舟文化	286,200	661,122.00	0.02
850	000050	深天马 A	90,400	658,112.00	0.02
851	002664	信质集团	55,100	655,690.00	0.02
852	002286	保龄宝	118,800	654,588.00	0.02
853	600967	内蒙一机	90,900	654,480.00	0.02
854	603538	美诺华	58,500	653,445.00	0.02
855	300773	拉卡拉	52,500	652,575.00	0.02
856	603788	宁波高发	53,000	650,840.00	0.02
857	002546	新联电子	200,100	650,325.00	0.02
858	688283	坤恒顺维	18,896	649,644.48	0.02
859	603429	集友股份	156,400	649,060.00	0.02
860	301111	粤万年青	46,500	648,675.00	0.02
861	600423	柳化股份	280,700	648,417.00	0.02
862	600525	长园集团	152,000	647,520.00	0.02
863	605018	长华集团	71,400	646,884.00	0.02
864	002214	大立科技	57,300	646,344.00	0.02
865	000738	航发控制	32,100	644,247.00	0.02
866	600099	林海股份	93,400	642,592.00	0.02
867	003027	同兴环保	52,200	642,060.00	0.02
868	688176	亚虹医药	125,569	641,657.59	0.02
869	603967	中创物流	68,800	639,840.00	0.02
870	688209	英集芯	51,558	639,834.78	0.02
871	002282	博深股份	100,100	639,639.00	0.02
872	688550	瑞联新材	27,563	639,185.97	0.02
873	002591	恒大高新	174,600	639,036.00	0.02
874	301378	通达海	29,420	638,414.00	0.02
875	603868	飞科电器	16,600	637,440.00	0.02
876	301365	矩阵股份	58,000	637,420.00	0.02
877	603085	天成自控	71,200	636,528.00	0.02
878	603366	日出东方	178,000	635,460.00	0.02
879	301380	挖金客	19,800	634,392.00	0.02

880	603201	常润股份	26,200	634,040.00	0.02
881	300800	力合科技	61,000	631,960.00	0.02
882	600097	开创国际	76,500	629,595.00	0.02
883	002387	维信诺	103,500	629,280.00	0.02
884	603053	成都燃气	65,000	627,900.00	0.02
885	600636	国新文化	83,400	625,500.00	0.02
886	300657	弘信电子	41,600	624,832.00	0.02
887	603086	先达股份	164,300	624,340.00	0.02
888	300235	方直科技	77,500	621,550.00	0.02
889	001287	中电港	37,500	619,875.00	0.02
890	300464	星徽股份	176,100	619,872.00	0.02
891	000925	众合科技	94,200	619,836.00	0.02
892	300809	华辰装备	30,500	617,930.00	0.02
893	300222	科大智能	115,200	617,472.00	0.02
894	301213	观想科技	22,600	617,206.00	0.02
895	300112	万讯自控	89,300	616,170.00	0.02
896	301157	华塑科技	18,900	616,140.00	0.02
897	300895	铜牛信息	24,800	615,784.00	0.02
898	300261	雅本化学	115,900	614,270.00	0.02
899	300410	正业科技	119,500	611,840.00	0.02
900	002645	华宏科技	96,200	611,832.00	0.02
901	001207	联科科技	42,100	611,292.00	0.02
902	600784	鲁银投资	128,500	609,090.00	0.02
903	300269	联建光电	242,300	608,173.00	0.02
904	002297	博云新材	101,100	606,600.00	0.02
905	300440	运达科技	115,200	604,800.00	0.02
906	603045	福达合金	60,900	604,737.00	0.02
907	002451	摩恩电气	112,600	604,662.00	0.02
908	300980	祥源新材	38,200	602,032.00	0.02
909	002769	普路通	114,900	600,927.00	0.02
910	002849	威星智能	53,800	600,408.00	0.02
911	301528	多浦乐	14,000	599,760.00	0.02
912	603488	展鹏科技	88,000	598,400.00	0.02
913	300512	中亚股份	100,900	597,328.00	0.02
914	301056	森赫股份	77,600	595,192.00	0.02
915	300535	达威股份	50,400	594,720.00	0.02
916	301045	天禄科技	31,200	594,672.00	0.02
917	300610	晨化股份	67,800	594,606.00	0.02
918	300371	汇中股份	70,900	593,433.00	0.02
919	688510	航亚科技	32,203	592,857.23	0.02
920	600961	株冶集团	62,800	592,832.00	0.02
921	001268	联合精密	35,000	592,550.00	0.02
922	001206	依依股份	45,500	592,410.00	0.02

923	003036	泰坦股份	74,100	592,059.00	0.02
924	301003	江苏博云	27,500	591,525.00	0.02
925	300131	英唐智控	132,900	591,405.00	0.02
926	300683	海特生物	27,900	590,364.00	0.02
927	300853	申昊科技	40,600	590,324.00	0.02
928	002576	通达动力	52,000	590,200.00	0.02
929	300509	新美星	126,100	590,148.00	0.02
930	300870	欧陆通	13,600	589,968.00	0.02
931	002972	科安达	64,400	589,904.00	0.02
932	688168	安博通	21,921	589,674.90	0.02
933	300154	瑞凌股份	110,500	588,965.00	0.02
934	002980	华盛昌	26,900	588,841.00	0.02
935	600235	民丰特纸	128,000	588,800.00	0.02
936	301198	喜悦智行	73,500	588,735.00	0.02
937	002686	亿利达	140,500	588,695.00	0.02
938	300299	富春股份	169,600	588,512.00	0.02
939	301032	新柴股份	87,700	588,467.00	0.02
940	301117	佳缘科技	22,800	588,240.00	0.02
941	001223	欧克科技	16,700	587,673.00	0.02
942	002870	香山股份	19,700	587,651.00	0.02
943	002825	纳尔股份	94,300	587,489.00	0.02
944	300635	中达安	77,800	587,390.00	0.02
945	001317	三羊马	25,000	587,250.00	0.02
946	000701	厦门信达	157,000	587,180.00	0.02
947	002213	大为股份	60,200	586,950.00	0.02
948	300931	通用电梯	107,100	586,908.00	0.02
949	300549	优德精密	43,400	586,768.00	0.02
950	301040	中环海陆	59,200	586,672.00	0.02
951	300126	锐奇股份	129,100	584,823.00	0.02
952	600676	交运股份	211,100	584,747.00	0.02
953	300854	中兰环保	58,800	584,472.00	0.02
954	301222	浙江恒威	23,600	584,336.00	0.02
955	000576	甘化科工	97,300	583,800.00	0.02
956	605033	美邦股份	47,000	583,740.00	0.02
957	301122	采纳股份	31,000	583,730.00	0.02
958	600819	耀皮玻璃	138,300	583,626.00	0.02
959	300883	龙利得	137,900	583,317.00	0.02
960	003003	天元股份	73,100	582,607.00	0.02
961	002949	华阳国际	61,900	582,479.00	0.02
962	301052	果麦文化	28,400	582,200.00	0.02
963	301075	多瑞医药	36,600	581,940.00	0.02
964	301066	万事利	71,800	581,580.00	0.02
965	688596	正帆科技	17,617	581,361.00	0.02

966	002858	力盛体育	55,900	581,360.00	0.02
967	301010	晶雪节能	50,500	581,255.00	0.02
968	002337	赛象科技	152,800	580,640.00	0.02
969	600718	东软集团	70,200	580,554.00	0.02
970	002152	广电运通	55,400	579,484.00	0.02
971	300935	盈建科	37,300	578,523.00	0.02
972	002782	可立克	52,200	578,376.00	0.02
973	002405	四维图新	92,900	577,838.00	0.02
974	603818	曲美家居	207,100	577,809.00	0.02
975	300860	锋尚文化	27,400	576,496.00	0.02
976	603065	宿迁联盛	76,900	574,443.00	0.02
977	603331	百达精工	63,200	573,224.00	0.02
978	688316	青云科技	19,150	572,776.50	0.02
979	000997	新大陆	41,100	571,701.00	0.02
980	605168	三人行	21,700	571,361.00	0.02
981	300942	易瑞生物	94,900	568,451.00	0.02
982	001308	康冠科技	25,200	567,000.00	0.02
983	688171	纬德信息	37,544	566,163.52	0.02
984	300176	派生科技	128,000	564,480.00	0.02
985	601598	中国外运	100,100	563,563.00	0.02
986	300329	海伦钢琴	149,400	563,238.00	0.02
987	603687	大胜达	78,500	562,060.00	0.02
988	603330	天洋新材	117,100	560,909.00	0.02
989	603912	佳力图	93,100	558,600.00	0.02
990	600455	博通股份	37,800	556,416.00	0.02
991	301072	中捷精工	27,900	554,652.00	0.02
992	603109	神驰机电	42,100	551,931.00	0.02
993	000045	深纺织 A	68,300	547,766.00	0.02
994	603903	中持股份	77,800	545,378.00	0.02
995	002084	海鸥住工	220,500	540,225.00	0.02
996	300334	津膜科技	115,200	539,136.00	0.02
997	301155	海力风电	13,400	539,082.00	0.02
998	603022	新通联	73,900	537,992.00	0.02
999	603039	泛微网络	16,900	536,744.00	0.02
1,000	601678	滨化股份	153,500	534,180.00	0.02
1,001	603861	白云电器	63,700	533,169.00	0.02
1,002	000717	中南股份	313,800	530,322.00	0.02
1,003	301133	金钟股份	24,300	529,497.00	0.02
1,004	002796	世嘉科技	66,500	528,675.00	0.02
1,005	300491	通合科技	36,800	528,448.00	0.02
1,006	603122	合富中国	103,600	527,324.00	0.02
1,007	300263	隆华科技	93,900	525,840.00	0.02
1,008	300405	科隆股份	148,100	525,755.00	0.02

1,009	301051	信濠光电	19,980	524,075.40	0.02
1,010	301098	金埔园林	69,100	523,087.00	0.02
1,011	688685	迈信林	21,329	521,494.05	0.02
1,012	688170	德龙激光	23,634	520,420.68	0.02
1,013	001209	洪兴股份	37,500	517,500.00	0.02
1,014	300886	华业香料	31,500	517,230.00	0.02
1,015	600722	金牛化工	136,300	516,577.00	0.02
1,016	603329	上海雅仕	46,800	515,736.00	0.02
1,017	002494	华斯股份	164,500	513,240.00	0.02
1,018	688060	云涌科技	15,979	511,967.16	0.02
1,019	301291	明阳电气	17,000	510,850.00	0.02
1,020	601999	出版传媒	97,700	509,994.00	0.02
1,021	603810	丰山集团	60,700	507,452.00	0.02
1,022	600965	福成股份	139,100	506,324.00	0.02
1,023	603839	安正时尚	115,800	506,046.00	0.02
1,024	000663	永安林业	120,500	504,895.00	0.02
1,025	002809	红墙股份	70,400	504,768.00	0.02
1,026	300746	汉嘉设计	80,200	503,656.00	0.02
1,027	688383	新益昌	9,609	500,724.99	0.02
1,028	688237	超卓航科	24,940	500,047.00	0.02
1,029	688201	信安世纪	42,260	499,090.60	0.02
1,030	603235	天新药业	20,700	497,421.00	0.02
1,031	600619	海立股份	96,000	496,320.00	0.02
1,032	688322	奥比中光	18,494	493,974.74	0.02
1,033	000678	襄阳轴承	131,200	493,312.00	0.02
1,034	605303	园林股份	73,600	493,120.00	0.02
1,035	002589	瑞康医药	224,100	493,020.00	0.02
1,036	002961	瑞达期货	45,000	492,750.00	0.02
1,037	603738	泰晶科技	36,000	491,040.00	0.02
1,038	001260	坤泰股份	35,100	488,943.00	0.02
1,039	002575	群兴玩具	110,200	484,880.00	0.02
1,040	603359	东珠生态	133,500	484,605.00	0.02
1,041	603933	睿能科技	37,600	483,536.00	0.02
1,042	600880	博瑞传播	128,400	482,784.00	0.02
1,043	002682	龙洲股份	135,400	482,024.00	0.02
1,044	601326	秦港股份	151,800	481,206.00	0.02
1,045	600243	青海华鼎	178,800	480,972.00	0.02
1,046	603195	公牛集团	6,220	479,686.40	0.02
1,047	002265	建设工业	55,100	475,513.00	0.02
1,048	300749	顶固集创	89,400	473,820.00	0.02
1,049	603601	再升科技	171,100	472,236.00	0.02
1,050	600963	岳阳林纸	127,700	468,659.00	0.02
1,051	002082	万邦德	111,300	468,573.00	0.02

1,052	600446	金证股份	47,100	467,703.00	0.02
1,053	001236	弘业期货	65,700	467,127.00	0.02
1,054	688010	福光股份	29,828	464,421.96	0.02
1,055	688323	瑞华泰	45,989	463,109.23	0.02
1,056	603833	欧派家居	8,600	460,616.00	0.02
1,057	002631	德尔未来	127,400	456,092.00	0.02
1,058	603686	福龙马	59,500	453,390.00	0.02
1,059	003012	东鹏控股	74,200	453,362.00	0.02
1,060	603811	诚意药业	72,500	453,125.00	0.02
1,061	688418	震有科技	26,447	453,037.11	0.02
1,062	600642	申能股份	51,300	452,979.00	0.02
1,063	603216	梦天家居	49,200	451,656.00	0.02
1,064	603365	水星家纺	28,800	450,720.00	0.02
1,065	601956	东贝集团	98,300	450,214.00	0.02
1,066	603326	我乐家居	80,600	448,136.00	0.02
1,067	603176	汇通集团	119,900	447,227.00	0.02
1,068	601163	三角轮胎	29,300	445,946.00	0.02
1,069	603551	奥普科技	45,400	444,920.00	0.02
1,070	301268	铭利达	28,500	443,175.00	0.02
1,071	300591	万里马	142,000	443,040.00	0.02
1,072	600689	上海三毛	65,400	441,450.00	0.02
1,073	603939	益丰药房	17,740	435,517.00	0.02
1,074	605133	嵘泰股份	23,700	434,421.00	0.02
1,075	603648	畅联股份	54,800	434,016.00	0.02
1,076	300471	厚普股份	54,100	426,308.00	0.02
1,077	605001	威奥股份	87,500	426,125.00	0.02
1,078	603213	镇洋发展	56,700	424,116.00	0.01
1,079	603177	德创环保	60,300	423,909.00	0.01
1,080	002109	兴化股份	131,500	423,430.00	0.01
1,081	603316	诚邦股份	116,700	421,287.00	0.01
1,082	300412	迦南科技	145,800	419,904.00	0.01
1,083	600678	四川金顶	80,500	419,405.00	0.01
1,084	601012	隆基绿能	29,800	417,796.00	0.01
1,085	600017	日照港	156,100	416,787.00	0.01
1,086	688003	天准科技	12,700	416,052.00	0.01
1,087	300840	酷特智能	44,100	407,925.00	0.01
1,088	002671	龙泉股份	113,600	407,824.00	0.01
1,089	688360	德马科技	33,264	400,498.56	0.01
1,090	002524	光正眼科	126,000	396,900.00	0.01
1,091	002103	广博股份	79,900	396,304.00	0.01
1,092	300658	延江股份	93,800	395,836.00	0.01
1,093	600665	天地源	178,200	395,604.00	0.01
1,094	600319	亚星化学	119,200	394,552.00	0.01

1,095	688660	电气风电	136,850	394,128.00	0.01
1,096	600493	凤竹纺织	90,200	392,370.00	0.01
1,097	603272	联翔股份	46,000	391,000.00	0.01
1,098	000059	华锦股份	92,700	388,413.00	0.01
1,099	300587	天铁股份	95,600	386,224.00	0.01
1,100	605007	五洲特纸	30,200	381,426.00	0.01
1,101	603689	皖天然气	45,800	376,476.00	0.01
1,102	300902	国安达	18,900	375,543.00	0.01
1,103	300892	品渥食品	27,500	375,100.00	0.01
1,104	688006	杭可科技	21,474	374,721.30	0.01
1,105	300143	盈康生命	49,500	372,735.00	0.01
1,106	600609	金杯汽车	107,000	371,290.00	0.01
1,107	300823	建科智能	30,500	370,575.00	0.01
1,108	688503	聚和材料	13,161	369,824.10	0.01
1,109	600746	江苏索普	62,500	368,125.00	0.01
1,110	605183	确成股份	23,600	364,856.00	0.01
1,111	300987	川网传媒	29,900	362,986.00	0.01
1,112	000635	英力特	61,900	362,115.00	0.01
1,113	300611	美力科技	47,500	361,950.00	0.01
1,114	002062	宏润建设	104,000	361,920.00	0.01
1,115	002329	皇氏集团	132,300	358,533.00	0.01
1,116	002996	顺博合金	61,240	358,254.00	0.01
1,117	300582	英飞特	41,800	357,808.00	0.01
1,118	605389	长龄液压	16,900	354,731.00	0.01
1,119	688128	中国电研	20,513	353,028.73	0.01
1,120	688432	有研硅	36,364	352,367.16	0.01
1,121	600281	华阳新材	134,400	352,128.00	0.01
1,122	600768	宁波富邦	49,900	349,799.00	0.01
1,123	002565	顺灏股份	146,200	349,418.00	0.01
1,124	688135	利扬芯片	21,759	348,579.18	0.01
1,125	301419	阿莱德	14,000	347,620.00	0.01
1,126	603277	银都股份	11,500	345,460.00	0.01
1,127	000887	中鼎股份	28,200	345,168.00	0.01
1,128	688147	微导纳米	13,827	344,292.30	0.01
1,129	605060	联德股份	23,900	343,443.00	0.01
1,130	600847	万里股份	53,800	341,630.00	0.01
1,131	301009	可靠股份	45,400	339,138.00	0.01
1,132	605009	豪悦护理	8,500	335,240.00	0.01
1,133	301298	东利机械	26,000	331,500.00	0.01
1,134	688317	之江生物	22,929	330,406.89	0.01
1,135	603955	大千生态	38,300	329,380.00	0.01
1,136	600936	广西广电	162,800	328,856.00	0.01
1,137	600128	苏豪弘业	51,600	328,692.00	0.01

1, 138	600822	上海物贸	42,000	328,440.00	0.01
1, 139	600730	中国高科	82,200	327,978.00	0.01
1, 140	300981	中红医疗	33,900	324,423.00	0.01
1, 141	300426	唐德影视	47,700	323,406.00	0.01
1, 142	300510	金冠股份	92,300	323,050.00	0.01
1, 143	002643	万润股份	32,300	323,000.00	0.01
1, 144	001227	兰州银行	135,300	322,014.00	0.01
1, 145	300389	艾比森	26,000	319,280.00	0.01
1, 146	605287	德才股份	25,200	317,268.00	0.01
1, 147	600939	重庆建工	136,100	315,752.00	0.01
1, 148	301303	真兰仪表	27,200	313,344.00	0.01
1, 148	601599	浙文影业	108,800	313,344.00	0.01
1, 149	002658	雪迪龙	60,700	311,391.00	0.01
1, 150	603112	华翔股份	29,500	310,045.00	0.01
1, 151	600081	东风科技	35,400	309,750.00	0.01
1, 152	605566	福莱蒾特	20,300	309,169.00	0.01
1, 153	603698	航天工程	25,800	308,826.00	0.01
1, 154	600180	瑞茂通	80,800	307,848.00	0.01
1, 155	000088	盐田港	67,800	307,134.00	0.01
1, 156	002245	蔚蓝锂芯	39,600	306,900.00	0.01
1, 157	301292	海科新源	24,800	306,776.00	0.01
1, 158	002161	远望谷	66,300	306,306.00	0.01
1, 159	600055	万东医疗	24,700	305,045.00	0.01
1, 160	688162	巨一科技	15,636	304,589.28	0.01
1, 161	603813	原尚股份	32,100	303,024.00	0.01
1, 162	688081	兴图新科	34,204	300,995.20	0.01
1, 163	603682	锦和商管	75,400	300,846.00	0.01
1, 164	300550	和仁科技	31,800	300,510.00	0.01
1, 165	300018	中元股份	65,100	299,460.00	0.01
1, 166	002909	集泰股份	72,800	298,480.00	0.01
1, 167	603928	兴业股份	38,050	297,931.50	0.01
1, 168	300564	筑博设计	34,900	297,697.00	0.01
1, 169	688227	品高股份	24,507	296,779.77	0.01
1, 170	301113	雅艺科技	14,900	296,361.00	0.01
1, 171	002685	华东重机	126,000	296,100.00	0.01
1, 172	301273	瑞晨环保	19,000	295,830.00	0.01
1, 173	301288	清研环境	26,500	295,740.00	0.01
1, 174	688067	爱威科技	20,569	295,165.15	0.01
1, 175	300363	博腾股份	24,700	295,165.00	0.01
1, 176	603968	醋化股份	29,700	294,624.00	0.01
1, 177	003007	直真科技	11,800	294,410.00	0.01
1, 178	600137	浪莎股份	24,800	294,376.00	0.01
1, 179	600272	开开实业	34,200	294,120.00	0.01

1, 180	002873	新天药业	35, 400	293, 820. 00	0. 01
1, 181	603909	建发合诚	35, 300	293, 696. 00	0. 01
1, 182	002480	新筑股份	94, 100	293, 592. 00	0. 01
1, 183	300929	华骐环保	40, 100	293, 532. 00	0. 01
1, 184	600232	金鹰股份	68, 100	293, 511. 00	0. 01
1, 185	603159	上海亚虹	28, 100	292, 521. 00	0. 01
1, 186	000533	顺钠股份	88, 800	292, 152. 00	0. 01
1, 187	603655	朗博科技	19, 700	291, 954. 00	0. 01
1, 188	688021	奥福环保	31, 715	291, 778. 00	0. 01
1, 189	300478	杭州高新	37, 400	291, 720. 00	0. 01
1, 190	300955	嘉亨家化	23, 000	291, 410. 00	0. 01
1, 191	603630	拉芳家化	27, 700	291, 127. 00	0. 01
1, 192	688296	和达科技	29, 946	291, 075. 12	0. 01
1, 193	688229	博睿数据	11, 307	290, 816. 04	0. 01
1, 194	688026	洁特生物	29, 181	290, 642. 76	0. 01
1, 195	688113	联测科技	10, 244	290, 622. 28	0. 01
1, 196	000869	张裕 A	13, 600	290, 360. 00	0. 01
1, 197	688580	伟思医疗	10, 827	289, 730. 52	0. 01
1, 198	000633	合金投资	73, 500	289, 590. 00	0. 01
1, 199	688079	美迪凯	38, 904	288, 667. 68	0. 01
1, 200	600156	华升股份	92, 500	287, 675. 00	0. 01
1, 201	600470	六国化工	75, 300	287, 646. 00	0. 01
1, 202	605068	明新旭腾	21, 800	287, 324. 00	0. 01
1, 203	603182	嘉华股份	27, 300	287, 196. 00	0. 01
1, 204	002205	国统股份	45, 800	287, 166. 00	0. 01
1, 205	002942	新农股份	24, 300	286, 497. 00	0. 01
1, 206	688329	艾隆科技	19, 261	286, 218. 46	0. 01
1, 207	300528	幸福蓝海	45, 500	285, 740. 00	0. 01
1, 208	605366	宏柏新材	49, 000	284, 690. 00	0. 01
1, 209	600278	东方创业	52, 600	282, 462. 00	0. 01
1, 210	688189	南新制药	49, 818	280, 475. 34	0. 01
1, 211	000720	新能泰山	116, 100	279, 801. 00	0. 01
1, 212	603535	嘉诚国际	17, 300	279, 222. 00	0. 01
1, 213	605180	华生科技	23, 200	274, 920. 00	0. 01
1, 214	301100	风光股份	21, 000	272, 790. 00	0. 01
1, 215	603077	和邦生物	165, 000	272, 250. 00	0. 01
1, 216	300257	开山股份	26, 900	271, 690. 00	0. 01
1, 217	605008	长鸿高科	20, 500	268, 550. 00	0. 01
1, 218	601500	通用股份	49, 920	266, 572. 80	0. 01
1, 219	002795	永和智控	70, 900	263, 748. 00	0. 01
1, 220	300879	大叶股份	19, 700	263, 586. 00	0. 01
1, 221	600352	浙江龙盛	30, 500	261, 995. 00	0. 01
1, 222	600731	湖南海利	56, 330	260, 244. 60	0. 01

1, 223	002692	远程股份	77, 600	259, 960. 00	0. 01
1, 224	600284	浦东建设	48, 500	258, 990. 00	0. 01
1, 225	600620	天宸股份	60, 500	258, 335. 00	0. 01
1, 226	002718	友邦吊顶	24, 600	256, 824. 00	0. 01
1, 227	600561	江西长运	70, 500	256, 620. 00	0. 01
1, 228	002392	北京利尔	81, 200	255, 780. 00	0. 01
1, 229	300996	普联软件	17, 200	252, 324. 00	0. 01
1, 230	600805	悦达投资	61, 700	249, 268. 00	0. 01
1, 231	603033	三维股份	21, 300	249, 210. 00	0. 01
1, 232	002571	德力股份	51, 000	248, 370. 00	0. 01
1, 233	002723	小崧股份	39, 100	245, 157. 00	0. 01
1, 234	603351	威尔药业	12, 100	245, 146. 00	0. 01
1, 235	002175	东方智造	137, 800	242, 528. 00	0. 01
1, 236	605266	健之佳	9, 300	241, 335. 00	0. 01
1, 237	301119	正强股份	12, 700	240, 284. 00	0. 01
1, 238	688663	新风光	10, 282	239, 262. 14	0. 01
1, 239	603353	和顺石油	18, 300	237, 168. 00	0. 01
1, 240	300213	佳讯飞鸿	41, 400	235, 980. 00	0. 01
1, 241	603309	维力医疗	21, 300	234, 513. 00	0. 01
1, 242	603337	杰克股份	8, 900	234, 248. 00	0. 01
1, 243	002617	露笑科技	48, 600	233, 280. 00	0. 01
1, 244	603595	东尼电子	11, 200	230, 608. 00	0. 01
1, 245	603335	迪生力	55, 900	229, 190. 00	0. 01
1, 246	605055	迎丰股份	56, 100	228, 327. 00	0. 01
1, 247	002418	康盛股份	120, 700	228, 123. 00	0. 01
1, 248	688393	安必平	14, 810	227, 037. 30	0. 01
1, 249	605151	西上海	15, 400	225, 610. 00	0. 01
1, 250	603040	新坐标	11, 300	225, 209. 00	0. 01
1, 251	600615	丰华股份	26, 400	223, 344. 00	0. 01
1, 252	002237	恒邦股份	19, 400	223, 294. 00	0. 01
1, 253	600883	博闻科技	36, 200	222, 630. 00	0. 01
1, 254	605298	必得科技	26, 300	218, 290. 00	0. 01
1, 255	603181	皇马科技	24, 200	217, 558. 00	0. 01
1, 256	605336	帅丰电器	19, 000	214, 130. 00	0. 01
1, 257	688403	汇成股份	25, 100	212, 848. 00	0. 01
1, 258	603607	京华激光	16, 500	206, 415. 00	0. 01
1, 259	605305	中际联合	8, 000	206, 320. 00	0. 01
1, 260	601279	英利汽车	55, 000	205, 150. 00	0. 01
1, 261	600033	福建高速	61, 000	204, 350. 00	0. 01
1, 262	601098	中南传媒	16, 400	203, 688. 00	0. 01
1, 263	600408	安泰集团	128, 100	202, 398. 00	0. 01
1, 264	002678	珠江钢琴	55, 800	201, 996. 00	0. 01
1, 265	000757	浩物股份	77, 300	194, 023. 00	0. 01

1,266	300399	天利科技	21,600	189,864.00	0.01
1,267	603558	健盛集团	19,000	189,050.00	0.01
1,268	603876	鼎胜新材	19,600	181,692.00	0.01
1,269	605099	共创草坪	9,500	179,645.00	0.01
1,270	002022	科华生物	31,500	177,975.00	0.01
1,271	688069	德林海	13,209	177,528.96	0.01
1,272	002672	东江环保	49,000	173,950.00	0.01
1,273	001225	和泰机电	6,200	171,802.00	0.01
1,274	002722	物产金轮	15,100	170,630.00	0.01
1,275	603169	兰石重装	37,600	169,200.00	0.01
1,276	600626	申达股份	69,100	167,222.00	0.01
1,277	600713	南京医药	39,100	165,002.00	0.01
1,278	605268	王力安防	22,900	163,277.00	0.01
1,279	002674	兴业科技	15,700	160,454.00	0.01
1,280	000545	金浦钛业	96,100	159,526.00	0.01
1,281	688277	天智航	20,015	154,916.10	0.01
1,282	002890	弘宇股份	18,980	152,219.60	0.01
1,283	000407	胜利股份	58,300	152,163.00	0.01
1,284	603586	金麒麟	10,300	152,028.00	0.01
1,285	603729	龙韵股份	11,400	151,164.00	0.01
1,286	688565	力源科技	31,328	146,928.32	0.01
1,287	688030	山石网科	14,026	146,571.70	0.01
1,288	603399	吉翔股份	23,000	142,370.00	0.01
1,289	600148	长春一东	11,800	140,420.00	0.00
1,290	688161	威高骨科	7,051	139,750.82	0.00
1,291	600817	宇通重工	16,600	136,120.00	0.00
1,292	603529	爱玛科技	4,900	133,917.00	0.00
1,293	301317	鑫磊股份	8,600	133,644.00	0.00
1,294	603408	建霖家居	10,100	133,219.00	0.00
1,295	301256	华融化学	21,400	131,396.00	0.00
1,296	300030	阳普医疗	34,500	128,340.00	0.00
1,297	002295	精艺股份	22,800	121,296.00	0.00
1,298	688225	亚信安全	10,664	120,823.12	0.00
1,299	300983	尤安设计	7,700	120,736.00	0.00
1,300	002534	西子洁能	11,400	114,114.00	0.00
1,301	300242	佳云科技	68,100	113,727.00	0.00
1,302	300849	锦盛新材	8,900	113,297.00	0.00
1,303	001210	金房能源	8,500	112,795.00	0.00
1,304	603978	深圳新星	12,300	110,085.00	0.00
1,305	003016	欣贺股份	17,300	108,298.00	0.00
1,306	600710	苏美达	12,900	105,135.00	0.00
1,307	001332	锡装股份	4,370	104,093.40	0.00
1,308	600581	八一钢铁	39,000	103,350.00	0.00

1,309	300651	金陵体育	8,400	101,808.00	0.00
1,310	688433	华曙高科	4,880	101,796.80	0.00
1,311	600241	时代万恒	17,500	97,300.00	0.00
1,312	600193	创兴资源	27,300	95,550.00	0.00
1,313	688600	皖仪科技	7,139	95,448.43	0.00
1,314	603976	正川股份	6,700	94,537.00	0.00
1,315	301023	江南奕帆	3,000	91,050.00	0.00
1,316	300472	新元科技	20,500	90,815.00	0.00
1,317	002529	海源复材	17,300	89,268.00	0.00
1,318	600882	妙可蓝多	7,100	88,537.00	0.00
1,319	002303	美盈森	36,700	88,447.00	0.00
1,320	300923	研奥股份	5,200	88,400.00	0.00
1,321	002426	胜利精密	53,800	85,004.00	0.00
1,322	603188	亚邦股份	36,900	83,394.00	0.00
1,323	600955	维远股份	5,600	80,696.00	0.00
1,324	300211	亿通科技	14,800	78,292.00	0.00
1,325	603239	浙江仙通	5,700	78,147.00	0.00
1,326	002798	帝欧家居	23,400	76,284.00	0.00
1,327	600657	信达地产	24,600	75,030.00	0.00
1,328	001202	炬申股份	6,500	73,645.00	0.00
1,329	605005	合兴股份	4,600	73,416.00	0.00
1,330	603886	元祖股份	4,800	72,288.00	0.00
1,331	002853	皮阿诺	9,700	72,071.00	0.00
1,332	001211	双枪科技	4,600	70,104.00	0.00
1,333	688435	英方软件	2,717	67,816.32	0.00
1,334	688387	信科移动	12,918	65,106.72	0.00
1,335	300267	尔康制药	30,200	62,816.00	0.00
1,336	002382	蓝帆医疗	14,200	61,344.00	0.00
1,337	000953	河化股份	26,300	61,279.00	0.00
1,338	603515	欧普照明	3,500	60,690.00	0.00
1,339	002620	瑞和股份	24,600	60,270.00	0.00
1,340	300523	辰安科技	3,900	58,851.00	0.00
1,341	002522	浙江众成	18,600	58,776.00	0.00
1,342	002691	冀凯股份	13,200	57,948.00	0.00
1,343	000595	宝塔实业	17,000	57,290.00	0.00
1,344	600202	哈空调	15,400	54,978.00	0.00
1,345	605507	国邦医药	3,200	53,280.00	0.00
1,346	301025	读客文化	5,300	52,947.00	0.00
1,347	300578	会畅通讯	3,500	51,800.00	0.00
1,348	300767	震安科技	5,900	50,032.00	0.00
1,349	002256	兆新股份	35,700	47,481.00	0.00
1,350	300219	鸿利智汇	8,300	46,397.00	0.00
1,351	600740	山西焦化	11,500	45,080.00	0.00

1,352	002088	鲁阳节能	3,400	41,106.00	0.00
1,353	603897	长城科技	2,300	40,365.00	0.00
1,354	002638	勤上股份	26,600	39,634.00	0.00
1,355	002921	联诚精密	3,800	38,038.00	0.00
1,356	600857	宁波中百	6,600	37,290.00	0.00
1,357	000820	神雾节能	18,500	37,185.00	0.00
1,358	688683	莱尔科技	2,292	36,694.92	0.00
1,359	000803	山高环能	10,000	34,900.00	0.00
1,360	300959	线上线下	1,200	33,732.00	0.00
1,361	601988	中国银行	6,000	27,720.00	0.00
1,362	002115	三维通信	5,600	27,216.00	0.00
1,363	603355	莱克电气	1,200	25,920.00	0.00
1,364	603100	川仪股份	1,100	25,861.00	0.00
1,365	600467	好当家	17,800	25,276.00	0.00
1,366	603080	新疆火炬	1,700	22,882.00	0.00
1,367	605299	舒华体育	2,600	21,112.00	0.00
1,368	002743	富煌钢构	3,461	12,771.09	0.00
1,369	600405	动力源	3,400	12,274.00	0.00
1,370	688475	萤石网络	352	12,006.72	0.00
1,371	688151	华强科技	944	11,752.80	0.00
1,372	688105	诺唯赞	559	11,185.59	0.00
1,373	603703	盛洋科技	1,100	11,033.00	0.00
1,374	002377	国创高新	6,000	10,620.00	0.00
1,375	000813	德展健康	5,100	10,608.00	0.00
1,376	300985	致远新能	600	9,612.00	0.00
1,377	301085	亚康股份	200	8,304.00	0.00
1,378	603281	江瀚新材	300	6,735.00	0.00
1,379	001316	润贝航科	200	6,262.00	0.00
1,380	300153	科泰电源	1,000	5,950.00	0.00
1,381	600448	华纺股份	2,600	5,122.00	0.00
1,382	300086	康芝药业	1,200	4,212.00	0.00
1,383	300750	宁德时代	22	3,960.66	0.00
1,384	002765	蓝黛科技	300	1,410.00	0.00
1,385	002910	庄园牧场	100	620.00	0.00
1,386	002435	ST长康	130,200	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	600036	招商银行	132,948,214.00	1.55
2	601857	中国石油	124,968,062.43	1.46
3	601318	中国平安	120,841,488.00	1.41

4	000333	美的集团	96,215,697.27	1.12
5	601398	工商银行	94,534,550.50	1.10
6	600900	长江电力	94,389,011.94	1.10
7	300750	宁德时代	92,351,191.60	1.08
8	000651	格力电器	88,426,574.76	1.03
9	601988	中国银行	83,404,628.00	0.97
10	600519	贵州茅台	82,570,908.20	0.96
11	300760	迈瑞医疗	71,963,445.65	0.84
12	601288	农业银行	70,359,491.00	0.82
13	600887	伊利股份	67,696,611.55	0.79
14	601658	邮储银行	66,783,511.00	0.78
15	603501	韦尔股份	65,930,483.97	0.77
16	000858	五粮液	64,988,904.00	0.76
17	601328	交通银行	63,203,213.00	0.74
18	600809	山西汾酒	63,183,679.20	0.74
19	601088	中国神华	62,682,144.88	0.73
20	601898	中煤能源	62,264,855.79	0.73

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	601857	中国石油	138,761,593.50	1.62
2	600036	招商银行	132,070,482.83	1.54
3	601318	中国平安	126,163,804.74	1.47
4	601319	中国人保	95,917,781.90	1.12
5	601398	工商银行	95,234,626.53	1.11
6	000938	紫光股份	94,062,808.18	1.10
7	300750	宁德时代	90,063,536.52	1.05
8	601988	中国银行	85,505,054.00	1.00
9	601728	中国电信	77,097,622.44	0.90
10	600519	贵州茅台	76,837,426.00	0.89
11	000333	美的集团	73,183,735.25	0.85
12	300760	迈瑞医疗	70,814,785.15	0.82
13	601288	农业银行	68,165,201.00	0.79
14	601658	邮储银行	67,361,184.00	0.78
15	600900	长江电力	66,142,734.45	0.77
16	601088	中国神华	65,627,552.78	0.76
17	601688	华泰证券	64,050,149.00	0.75
18	601328	交通银行	63,813,259.00	0.74
19	000858	五粮液	61,417,952.60	0.72
20	601166	兴业银行	59,910,897.73	0.70

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	15,356,711,799.55
卖出股票收入（成交）总额	18,999,114,492.81

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	3,999,999.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,999,999.43

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
国金量化 精选 A	26,956	45,834.87	45,473,562.37	3.68	1,190,051,279.97	96.32
国金量化 精选 C	46,217	27,855.87	115,436,832.18	8.97	1,171,977,682.37	91.03
合计	73,173	34,479.10	160,910,394.55	6.38	2,362,028,962.34	93.62

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	国金量化精选 A	2,166,723.78	0.1754
	国金量化精选 C	634,268.51	0.0493

有从业人员持有本基金			
	合计	2,800,992.29	0.1110

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	国金量化精选 A	50~100
	国金量化精选 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国金量化精选 A	>100
	国金量化精选 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化精选 A	国金量化精选 C
基金合同生效日（2022 年 3 月 18 日）基金份额总额	86,397,165.61	132,000,298.77
本报告期期初基金份额总额	2,985,976,281.19	3,379,761,416.09
本报告期基金总申购份额	264,841,406.18	1,042,245,445.43
减：本报告期基金总赎回份额	2,015,292,845.03	3,134,592,346.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,235,524,842.34	1,287,414,514.55

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 (%)	
广发证券	2	31,971,662,515.08	93.06	16,617,116.88	92.97	-
东海证券	2	2,384,163,777.28	6.94	1,256,575.83	7.03	-

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 (%)
广发证券	-	-	1,079,781.00	100.00	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-

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	《国金量化精选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	《国金量化精选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 08 日
5	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 02 月 08 日
6	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 02 月 08 日
7	《国金量化精选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	《国金基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 04 月 20 日

10	《国金量化精选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
11	《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
12	《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
13	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选 A 份额）基金产品资料概要（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	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选 C 份额）基金产品资料概要（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 1 月 1 日-2024 年 1 月 30 日	1,336,511,140.17	15,714,761.06	1,352,225,901.23	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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、国金量化精选混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化精选混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化精选混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

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