

# 国金智享量化选股混合型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 净资产变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	79
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	79
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	79
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	79
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	79
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	80
8.12 投资组合报告附注 .....	80
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>80</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	81
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>81</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>82</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	82
11.4 基金投资策略的改变 .....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	82
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	83
11.8 其他重大事件 .....	83
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>85</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>85</b>
13.1 备查文件目录 .....	85
13.2 存放地点 .....	85
13.3 查阅方式 .....	85

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金智享量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	国金智享量化选股混合	
基金主代码	018823	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 22 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,253,784,948.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	018823	018824
报告期末下属分级基金的份额总额	472,942,439.00 份	1,780,842,509.80 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国金基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞志海
	联系电话	010-88005852
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com
		罗琦
		020-66338888
		gzluoqi@gf.com.cn

客户服务电话	4000-2000-18	95575
传真	010-88005666	020-87553363-6847
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	广东省广州市黄埔区中新广州 知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	广州市天河区马场路 26 号广发 证券大厦 34 楼
邮政编码	100026	510627
法定代表人	邵海波	林传辉

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期 间数据和 指标	2025 年		2024 年		2023 年 8 月 22 日(基金 合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日	
	国金智享 量化选股 混合 A	国金智享 量化选股 混合 C	国金智享 量化选股 混合 A	国金智享 量化选股 混合 C	国金智享 量化选股 混合 A	国金智享 量化选股 混合 C
本期已实 现收益	106,784,8 99.88	245,828,3 05.06	- 34,866,23 9.25	- 48,726,27 5.36	- 24,346,75 0.03	- 34,403,07 4.35
本期利润	118,296,0 70.74	235,785,3 40.35	- 3,332,368 .76	- 13,472,11 8.74	- 50,321,96 3.62	- 69,276,46 7.62
加权平均 基金份额 本期利润	0.3371	0.2931	-0.0054	-0.0170	-0.0602	-0.0619
本期加权 平均净值 利润率	29.64%	24.08%	-0.62%	-1.96%	-6.19%	-6.37%

本期基金份额净值增长率	43.80%	43.08%	2.50%	1.99%	-6.00%	-6.17%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	154,976,199.95	555,679,722.54	-20,516,469.11	-30,340,844.44	-46,799,162.35	-62,474,786.11
期末可供分配基金份额利润	0.3277	0.3120	-0.0441	-0.0505	-0.0600	-0.0617
期末基金资产净值	655,251,935.37	2,438,469,926.50	448,678,846.41	574,548,929.02	733,657,638.18	950,854,904.02
期末基金份额净值	1.3855	1.3693	0.9635	0.9570	0.9400	0.9383
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	38.55%	36.93%	-3.65%	-4.30%	-6.00%	-6.17%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金智享量化选股混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.15%	1.33%	0.18%	0.81%	1.97%	0.52%
过去六个月	27.06%	1.13%	15.57%	0.76%	11.49%	0.37%

过去一年	43.80%	1.07%	16.78%	0.81%	27.02%	0.26%
自基金合同生效起至今	38.55%	1.20%	23.50%	0.94%	15.05%	0.26%

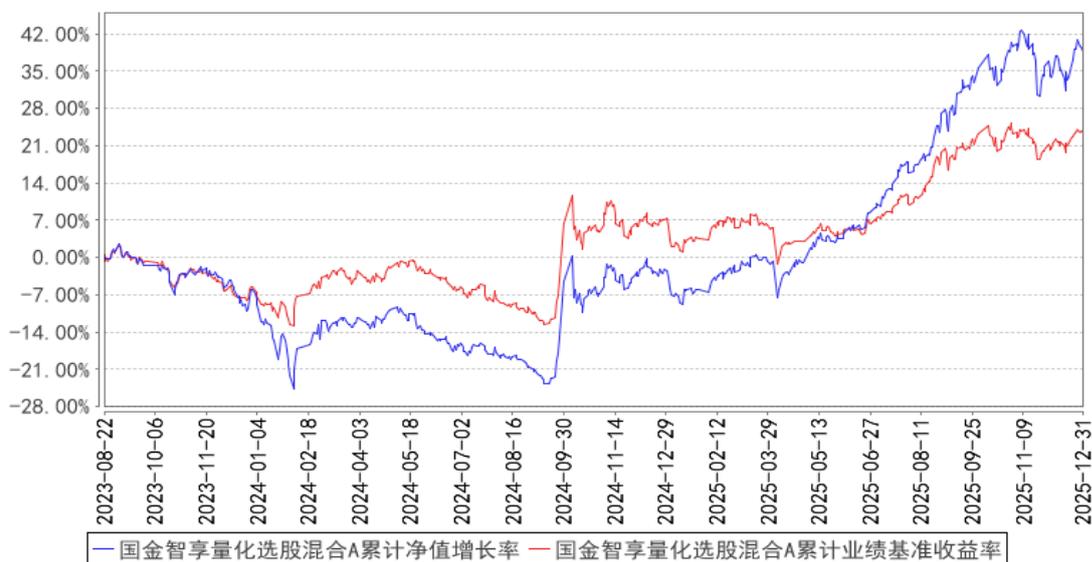
国金智享量化选股混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.02%	1.33%	0.18%	0.81%	1.84%	0.52%
过去六个月	26.74%	1.13%	15.57%	0.76%	11.17%	0.37%
过去一年	43.08%	1.07%	16.78%	0.81%	26.30%	0.26%
自基金合同生效起至今	36.93%	1.20%	23.50%	0.94%	13.43%	0.26%

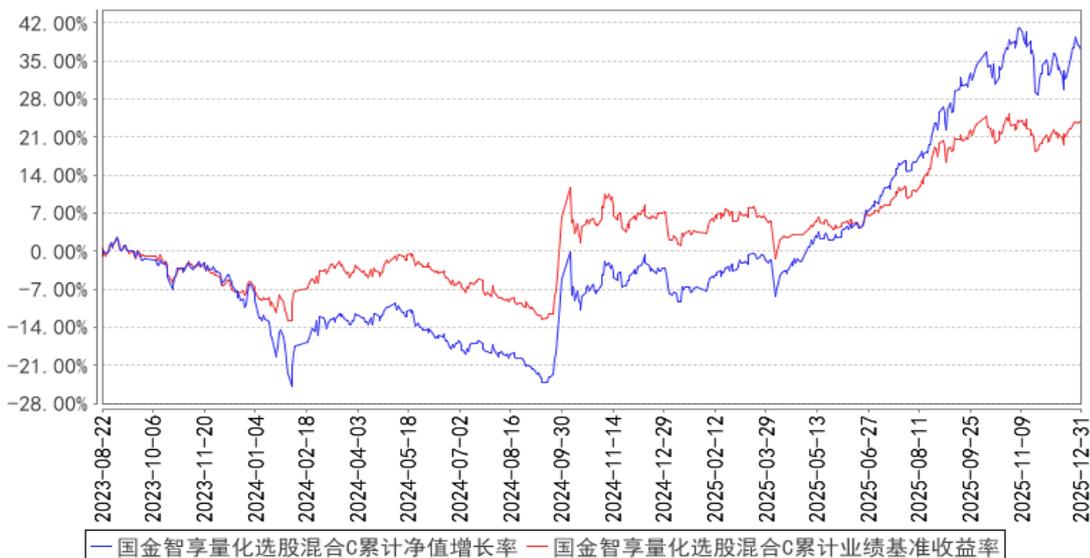
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%。

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

国金智享量化选股混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



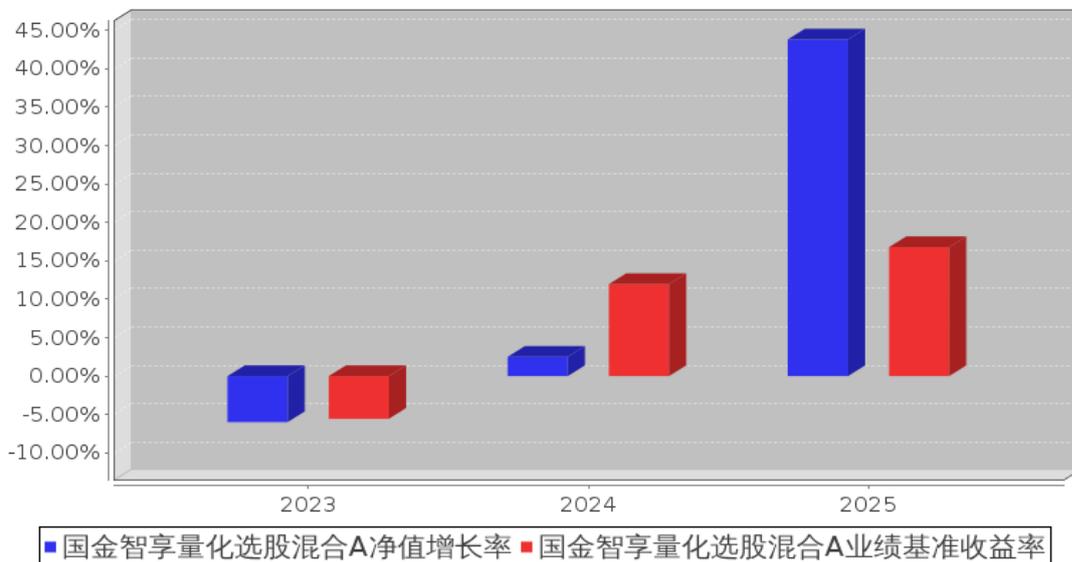
国金智享量化选股混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



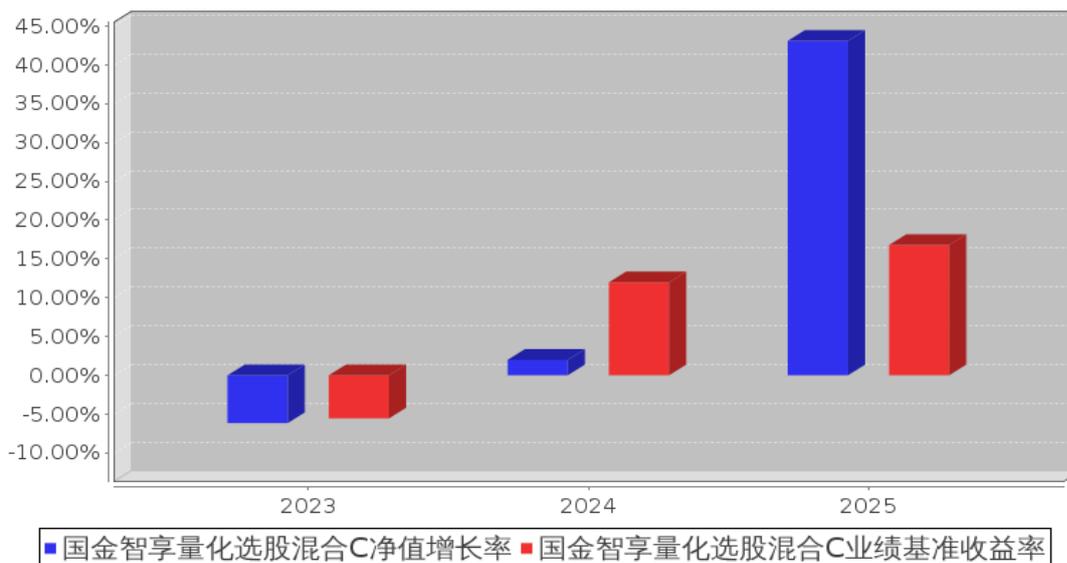
注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，图示日期为 2023 年 8 月 22 日至 2025 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金智享量化选股混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国金智享量化选股混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2023 年 8 月 22 日	-	9 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资中心副总经理。

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遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

易的执行日臻完善。(9) 监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

从业绩比较基准来看，本基金对标中大市值指数，因此投资组合的市值中枢处于中高水平。报告期内，本基金的超额收益水平略高于预期，主要系基准指数表现和当前市场环境共同作用的结果。

#### 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 1.3855 元，累计单位净值为 1.3855 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 43.80%，同期业绩比较基准增长率为 16.78%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.3693 元，累计单位净值为 1.3693 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 43.08%，同期业绩比较基准增长率为 16.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值

控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，国金基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、

基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人依法对国金基金管理有限公司编制和披露的国金智享量化选股混合型证券投资基金 2025 年年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2026)审字第 70015670_A09 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金智享量化选股混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金智享量化选股混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金智享量化选股混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金智享量化选股混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金智享量化选股混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	国金智享量化选股混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计

	<p>过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金智享量化选股混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金智享量化选股混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国金智享量化选股混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金智享量化选股混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发</p>

	现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺耀	王蕊
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2026 年 03 月 31 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	220,357,535.90	117,546,075.41
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,844,327,084.61	910,783,080.22
其中：股票投资		2,844,327,084.61	910,783,080.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	44,199,083.59	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		38,047,261.20	10,215.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		3,146,930,965.30	1,028,339,371.00
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>

<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		48,283,669.24	3,506,388.93
应付管理人报酬		3,228,920.04	1,085,792.07
应付托管费		538,153.33	180,965.35
应付销售服务费		1,077,175.55	253,073.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	81,185.27	85,376.01
负债合计		53,209,103.43	5,111,595.57
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,253,784,948.80	1,066,073,924.35
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	839,936,913.07	-42,846,148.92
净资产合计		3,093,721,861.87	1,023,227,775.43
负债和净资产总计		3,146,930,965.30	1,028,339,371.00

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，国金智享量化选股混合 A 基金份额净值 1.3855 元，基金份额总额 472,942,439.00 份；国金智享量化选股混合 C 基金份额净值 1.3693 元，基金份额总额 1,780,842,509.80 份。国金智享量化选股混合份额总额合计为 2,253,784,948.80 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		378,252,651.22	4,027,071.92
1. 利息收入		726,851.16	536,491.84
其中：存款利息收入	7.4.7.13	586,423.93	503,585.60
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		140,427.23	32,906.24
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		373,931,707.37	-63,999,007.71
其中：股票投资收益	7.4.7.14	355,965,793.15	-93,031,955.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收	7.4.7.17	-	-
益			
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	17,965,914.22	29,032,947.45
以摊余成本计			
量的金融资产终止确		-	-
认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益			
（损失以“-”号填	7.4.7.20	1,468,206.15	66,788,027.11
列）			
4. 汇兑收益（损失以		-	-
“-”号填列）			
5. 其他收入（损失以	7.4.7.21	2,125,886.54	701,560.68
“-”号填列）			
<b>减：二、营业总支出</b>		24,171,240.13	20,831,559.42
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,406,215.22	14,725,673.53
其中：暂估管理人报		-	-
酬			
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,734,369.13	2,454,278.84
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,841,155.78	3,446,607.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融		-	-
资产支出			
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	189,500.00	205,000.00
<b>三、利润总额（亏损</b>		354,081,411.09	-16,804,487.50
<b>总额以“-”号填列）</b>			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损</b>		354,081,411.09	-16,804,487.50
<b>以“-”号填列）</b>			
<b>五、其他综合收益的</b>		-	-
<b>税后净额</b>			
<b>六、综合收益总额</b>		354,081,411.09	-16,804,487.50

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国金智享量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,066,073,924. 35	-	-42,846,148.92	1,023,227,775.4 3
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,066,073,924. 35	-	-42,846,148.92	1,023,227,775.4 3
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,187,711,024. 45	-	882,783,061.99	2,070,494,086.4 4
(一)、综合收益总额	-	-	354,081,411.09	354,081,411.09
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,187,711,024. 45	-	528,701,650.90	1,716,412,675.3 5
其中：1. 基金申购款	2,916,310,537. 66	-	914,611,812.33	3,830,922,349.9 9
2. 基金赎回款	- 1,728,599,513. 21	-	- 385,910,161.43	- 2,114,509,674.6 4
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合	-	-	-	-

收益结转留存收益				
四、本期期末净资产	2,253,784,948.80	-	839,936,913.07	3,093,721,861.87
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,793,786,490.66	-	109,273,948.46	1,684,512,542.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,793,786,490.66	-	109,273,948.46	1,684,512,542.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-727,712,566.31	-	66,427,799.54	-661,284,766.77
(一)、综合收益总额	-	-	-16,804,487.50	-16,804,487.50
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-727,712,566.31	-	83,232,287.04	-644,480,279.27
其中：1. 基金申购款	116,544,835.17	-	-16,609,548.35	99,935,286.82
2. 基金赎回款	-844,257,401.48	-	99,841,835.39	-744,415,566.09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	1,066,073,924.35	-	-42,846,148.92	1,023,227,775.43
-----------	------------------	---	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国金智享量化选股混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1358 号文《关于准予国金智享量化选股混合型证券投资基金注册的批复》注册，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2023 年 8 月 22 日正式生效，本基金首次设立募集规模为 1,992,048,014.27 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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

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

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

## 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

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

### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产分类

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

#### (2) 金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且

符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 7.4.4.12 外币交易

无

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

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

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	20,381,059.56	19,490,409.03
等于：本金	20,362,596.84	19,485,366.77
加：应计利息	18,462.72	5,042.26
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	199,976,476.34	98,055,666.38
等于：本金	199,972,780.42	98,044,173.66
加：应计利息	3,695.92	11,492.72
减：坏账准备	-	-
合计	220,357,535.90	117,546,075.41

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,836,919,458.21	-	2,844,327,084.61	7,407,626.40
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		2,836,919,458.21	-	2,844,327,084.61	7,407,626.40
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		904,843,659.97	-	910,783,080.22	5,939,420.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		904,843,659.97	-	910,783,080.22	5,939,420.25

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	44,199,083.59	-
银行间市场	-	-
合计	44,199,083.59	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

## 7.4.7.8 其他资产

无

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	11,685.27	376.01
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	69,500.00	85,000.00
合计	81,185.27	85,376.01

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 国金智享量化选股混合 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	465,678,346.10	465,678,346.10
本期申购	419,672,496.05	419,672,496.05
本期赎回（以“-”号填列）	-412,408,403.15	-412,408,403.15
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	472,942,439.00	472,942,439.00

## 国金智享量化选股混合 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	600,395,578.25	600,395,578.25
本期申购	2,496,638,041.61	2,496,638,041.61
本期赎回（以“-”号填列）	-1,316,191,110.06	-1,316,191,110.06
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	1,780,842,509.80	1,780,842,509.80

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

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 国金智享量化选股混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,516,469.11	3,516,969.42	-16,999,499.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-20,516,469.11	3,516,969.42	-16,999,499.69
本期利润	106,784,899.88	11,511,170.86	118,296,070.74
本期基金份额交易产生的变动数	68,707,769.18	12,305,156.14	81,012,925.32
其中：基金申购款	114,020,897.31	26,511,058.02	140,531,955.33
基金赎回款	-45,313,128.13	-14,205,901.88	-59,519,030.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	154,976,199.95	27,333,296.42	182,309,496.37

##### 国金智享量化选股混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,340,844.44	4,494,195.21	-25,846,649.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-30,340,844.44	4,494,195.21	-25,846,649.23
本期利润	245,828,305.06	-10,042,964.71	235,785,340.35
本期基金份额交易产生的变动数	340,192,261.92	107,496,463.66	447,688,725.58
其中：基金申购款	616,725,374.11	157,354,482.89	774,079,857.00
基金赎回款	-276,533,112.19	-49,858,019.23	-326,391,131.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	555,679,722.54	101,947,694.16	657,627,416.70

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	436,001.11	162,450.02

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	123,557.19	341,135.58
结算备付金利息收入	-	-
其他	26,865.63	-
合计	586,423.93	503,585.60

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	355,965,793.15	-93,031,955.16
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	355,965,793.15	-93,031,955.16

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
卖出股票成交总 额	10,325,558,896.63	15,883,397,507.26
减：卖出股票成本 总额	9,953,324,501.85	15,951,435,848.86
减：交易费用	16,268,601.63	24,993,613.56
买卖股票差价收 入	355,965,793.15	-93,031,955.16

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

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

无

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

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

	31 日	月 31 日
股票投资产生的股利收益	17,965,914.22	29,032,947.45
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	17,965,914.22	29,032,947.45

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,468,206.15	66,788,027.11
股票投资	1,468,206.15	66,788,027.11
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	1,468,206.15	66,788,027.11

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,121,743.92	457,979.55
基金转换费收入	4,142.62	243,581.13
合计	2,125,886.54	701,560.68

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	65,000.00	85,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	4,500.00	-
合计	189,500.00	205,000.00

#### 7.4.7.24 分部报告

无

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	22,210,959,196.72	100.00	31,121,247,656.85	100.00

#### 7.4.10.1.2 债券交易

无

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	2,868,213,000.00	100.00	388,091,000.00	100.00

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	9,684,638.67	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
广发证券股份有限公司	15,056,608.38	100.00	-	-

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

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,406,215.22	14,725,673.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,251,706.42	7,254,989.01
应支付基金管理人的净管理费	9,154,508.80	7,470,684.52

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

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,734,369.13	2,454,278.84

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

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C	合计
国金基金管理有限公司	-	268,515.21	268,515.21
国金证券股份有限公司	-	110,907.18	110,907.18
广发证券股份有限公司	-	2,061,783.39	2,061,783.39
合计	-	2,441,205.78	2,441,205.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C	合计
国金基金管理有限公司	-	3,932.65	3,932.65
国金证券股份有限公司	-	79.51	79.51
广发证券股份有限公司	-	3,256,341.69	3,256,341.69
合计	-	3,260,353.85	3,260,353.85

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无

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

无

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无

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

无

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司-活期存款	20,381,059.56	436,001.11	19,490,409.03	162,450.02
广发证券股份有限公司-其他存款	199,976,476.34	123,557.19	98,055,666.38	341,135.58

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

2. 除其他存款外，本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

于本报告期内，本基金（因关联方名单更新而被动）持有并卖出管理人关联方发行的证券海光信息 10,700 股，成交总额为 1,531,423.36 元。（上年度可比期间：无其他关联交易事项）

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

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

无

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

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

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

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

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

31 日							
资产							
货币资金	220,357,535.90	-	-	-	-	-	220,357,535.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,844,327,084.61	2,844,327,084.61
买入返售金融资产	44,199,083.59	-	-	-	-	-	44,199,083.59
应收申购款	-	-	-	-	-	38,047,261.20	38,047,261.20
资产总计	264,556,619.49	-	-	-	-	-2,882,374,345.81	3,146,930,965.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	48,283,669.24	48,283,669.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,228,920.04	3,228,920.04
应付托管费	-	-	-	-	-	538,153.33	538,153.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,077,175.55	1,077,175.55
其他负债	-	-	-	-	-	81,185.27	81,185.27
负债总计	-	-	-	-	-	53,209,103.43	53,209,103.43
利率敏感度缺口	264,556,619.49	-	-	-	-	-2,829,165,242.38	3,093,721,861.87
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	117,546,075.41	-	-	-	-	-	117,546,075.41
交易性金融资产	-	-	-	-	-	910,783,080.22	910,783,080.22
应收申购款	-	-	-	-	-	10,215.37	10,215.37
资产总计	117,546,075.41	-	-	-	-	910,793,295.59	1,028,339,371.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,506,388.93	3,506,388.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,085,792.07	1,085,792.07
应付托管费	-	-	-	-	-	180,965.35	180,965.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	253,073.21	253,073.21
其他负债	-	-	-	-	-	85,376.01	85,376.01
负债总计	-	-	-	-	-	5,111,595.57	5,111,595.57
利率敏感度缺口	117,546,075.41	-	-	-	-	905,681,700.02	1,023,227,775.43

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有交易性债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因

而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,844,327,084.61	91.94	910,783,080.22	89.01
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	2,844,327,084.61	91.94	910,783,080.22	89.01

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

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 800 指数（000906.SH）变化 5%，其他变量不变；
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 800 指数数据回归得出，反映了基金和中证 800 指数的相关性。
	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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	+5%	147,569,740.12	47,023,057.38
	-5%	-147,569,740.12	-47,023,057.38

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	2,844,327,084.61	910,783,080.22
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	2,844,327,084.61	910,783,080.22

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

**7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况****7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

无

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

无

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****7.4.15.1 承诺事项**

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

**7.4.15.2 其他事项**

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**7.4.15.3 财务报表的批准**

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

**§ 8 投资组合报告****8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,844,327,084.61	90.38
	其中：股票	2,844,327,084.61	90.38
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	44,199,083.59	1.40
	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	220,357,535.90	7.00

8	其他各项资产	38,047,261.20	1.21
9	合计	3,146,930,965.30	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	16,913,717.00	0.55
B	采矿业	64,308,125.64	2.08
C	制造业	2,097,351,310.95	67.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,110,975.10	3.98
E	建筑业	22,721,752.00	0.73
F	批发和零售业	57,275,689.00	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	20,646,443.00	0.67
H	住宿和餐饮业	770,715.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,310,083.34	3.11
J	金融业	194,951,838.18	6.30
K	房地产业	5,772,284.00	0.19
L	租赁和商务服务业	72,824,016.00	2.35
M	科学研究和技术服务业	39,076,784.00	1.26
N	水利、环境和公共设施管理业	20,078,227.40	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	625,848.00	0.02
Q	卫生和社会工作	6,964,238.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	4,246,088.00	0.14
S	综合	378,950.00	0.01
	合计	2,844,327,084.61	91.94

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	154,100	94,001,000.00	3.04
2	300274	阳光电源	468,943	80,208,010.72	2.59
3	300750	宁德时代	187,081	68,707,368.06	2.22
4	300059	东方财富	2,713,300	62,894,294.00	2.03

5	000063	中兴通讯	1,524,367	57,682,047.28	1.86
6	002475	立讯精密	981,600	55,666,536.00	1.80
7	603986	兆易创新	249,700	53,498,225.00	1.73
8	002371	北方华创	106,735	48,999,903.80	1.58
9	300033	同花顺	146,000	47,038,280.00	1.52
10	002384	东山精密	553,000	46,811,450.00	1.51
11	600089	特变电工	2,056,795	45,701,984.90	1.48
12	600021	上海电力	2,262,700	45,299,254.00	1.46
13	002463	沪电股份	619,900	45,296,093.00	1.46
14	301308	江波龙	169,000	41,377,960.00	1.34
15	000651	格力电器	1,027,900	41,342,138.00	1.34
16	000338	潍柴动力	2,161,188	37,172,433.60	1.20
17	300476	胜宏科技	127,220	36,585,927.60	1.18
18	002709	天赐材料	786,469	36,437,108.77	1.18
19	300438	鹏辉能源	653,300	34,768,626.00	1.12
20	600309	万华化学	452,100	34,667,028.00	1.12
21	600519	贵州茅台	24,700	34,016,346.00	1.10
22	300014	亿纬锂能	512,200	33,682,272.00	1.09
23	601888	中国中免	353,500	33,426,960.00	1.08
24	000792	盐湖股份	1,185,090	33,372,134.40	1.08
25	603259	药明康德	365,300	33,110,792.00	1.07
26	600031	三一重工	1,555,100	32,859,263.00	1.06
27	300418	昆仑万维	784,350	32,707,395.00	1.06
28	603799	华友钴业	472,265	32,236,808.90	1.04
29	600183	生益科技	431,784	30,833,695.44	1.00
30	300058	蓝色光标	2,498,300	28,780,416.00	0.93
31	600926	杭州银行	1,871,400	28,594,992.00	0.92
32	601012	隆基绿能	1,442,400	26,251,680.00	0.85
33	001309	德明利	108,700	25,206,443.00	0.81
34	600795	国电电力	4,968,600	25,041,744.00	0.81
35	688472	阿特斯	1,676,407	24,995,228.37	0.81
36	300450	先导智能	485,200	24,250,296.00	0.78
37	603228	景旺电子	319,200	23,330,328.00	0.75
38	002074	国轩高科	576,100	22,531,271.00	0.73
39	002738	中矿资源	275,120	21,610,676.00	0.70
40	300073	当升科技	372,749	21,544,892.20	0.70
41	002916	深南电路	86,300	20,046,627.00	0.65
42	601360	三六零	1,717,300	19,182,241.00	0.62
43	600547	山东黄金	493,400	19,099,514.00	0.62
44	002129	TCL 中环	2,162,400	18,531,768.00	0.60
45	601377	兴业证券	2,484,104	18,432,051.68	0.60
46	000408	藏格矿业	211,400	17,842,160.00	0.58
47	600487	亨通光电	717,208	17,736,553.84	0.57

48	002353	杰瑞股份	250,100	17,714,583.00	0.57
49	002812	恩捷股份	283,200	16,040,448.00	0.52
50	601179	中国西电	1,739,159	15,826,346.90	0.51
51	603185	弘元绿能	518,068	15,801,074.00	0.51
52	600010	包钢股份	6,605,800	15,721,804.00	0.51
53	301358	湖南裕能	238,855	15,444,364.30	0.50
54	002851	麦格米特	167,900	15,122,753.00	0.49
55	002326	永太科技	603,585	15,041,338.20	0.49
56	300454	深信服	130,100	14,982,316.00	0.48
57	300769	德方纳米	329,200	14,488,092.00	0.47
58	600066	宇通客车	439,600	14,374,920.00	0.46
59	002222	福晶科技	243,010	13,691,183.40	0.44
60	300475	香农芯创	88,100	12,716,354.00	0.41
61	601688	华泰证券	519,400	12,252,646.00	0.40
62	000568	泸州老窖	102,700	11,935,794.00	0.39
63	002407	多氟多	329,800	11,183,518.00	0.36
64	000157	中联重科	1,269,000	10,951,470.00	0.35
65	605499	东鹏饮料	39,900	10,668,861.00	0.34
66	600938	中国海油	336,648	10,160,036.64	0.33
67	301526	国际复材	1,444,200	10,109,400.00	0.33
68	001203	大中矿业	321,600	9,857,040.00	0.32
69	000600	建投能源	1,130,200	9,640,606.00	0.31
70	603929	亚翔集成	100,400	9,588,200.00	0.31
71	301511	德福科技	262,700	9,402,033.00	0.30
72	603444	吉比特	20,700	8,773,695.00	0.28
73	002487	大金重工	167,600	8,703,468.00	0.28
74	600749	西藏旅游	485,700	8,295,756.00	0.27
75	603077	和邦生物	3,581,300	8,093,738.00	0.26
76	601225	陕西煤业	377,600	8,050,432.00	0.26
77	002028	思源电气	49,800	7,698,582.00	0.25
78	601456	国联民生	749,500	7,622,415.00	0.25
79	002240	盛新锂能	218,700	7,529,841.00	0.24
80	600522	中天科技	394,800	7,153,776.00	0.23
81	000708	中信特钢	426,000	6,973,620.00	0.23
82	603019	中科曙光	80,700	6,911,148.00	0.22
83	600026	中远海能	581,400	6,790,752.00	0.22
84	601319	中国人保	742,370	6,644,211.50	0.21
85	600617	国新能源	1,985,800	6,235,412.00	0.20
86	601138	工业富联	100,400	6,229,820.00	0.20
87	301018	申菱环境	94,700	6,015,344.00	0.19
88	300285	国瓷材料	211,171	5,788,197.11	0.19
89	000629	钒钛股份	1,852,900	5,743,990.00	0.19
90	000301	东方盛虹	515,600	5,614,884.00	0.18

91	002465	海格通信	353,300	5,564,475.00	0.18
92	601598	中国外运	899,600	5,451,576.00	0.18
93	000988	华工科技	66,800	5,299,244.00	0.17
94	002157	正邦科技	1,632,200	5,288,328.00	0.17
95	688072	拓荆科技	15,787	5,209,710.00	0.17
96	600168	武汉控股	1,001,600	5,098,144.00	0.16
97	002488	金固股份	560,800	4,929,432.00	0.16
98	300118	东方日升	327,600	4,802,616.00	0.16
99	002780	三夫户外	333,400	4,787,624.00	0.15
100	601061	中信金属	331,700	4,776,480.00	0.15
101	301095	广立微	66,200	4,747,202.00	0.15
102	600039	四川路桥	474,700	4,723,265.00	0.15
103	002044	美年健康	885,800	4,677,024.00	0.15
104	688228	开普云	21,990	4,279,473.90	0.14
105	002493	荣盛石化	364,000	4,262,440.00	0.14
106	601898	中煤能源	330,400	4,110,176.00	0.13
107	002281	光迅科技	57,400	4,015,130.00	0.13
108	300124	汇川技术	52,900	3,984,957.00	0.13
109	600988	赤峰黄金	126,800	3,961,232.00	0.13
110	301349	信德新材	82,800	3,884,148.00	0.13
111	601611	中国核建	285,200	3,844,496.00	0.12
112	600498	烽火通信	116,600	3,740,528.00	0.12
113	000811	冰轮环境	200,000	3,704,000.00	0.12
114	002136	安纳达	303,300	3,682,062.00	0.12
115	600011	华能国际	490,000	3,655,400.00	0.12
116	600879	航天电子	162,400	3,462,368.00	0.11
117	000619	海螺新材	555,500	3,449,655.00	0.11
118	002444	巨星科技	99,900	3,398,598.00	0.11
119	000933	神火股份	121,900	3,348,593.00	0.11
120	000543	皖能电力	420,100	3,339,795.00	0.11
121	000603	盛达资源	107,600	3,331,296.00	0.11
122	300616	尚品宅配	235,600	3,281,908.00	0.11
123	000831	中国稀土	68,911	3,200,226.84	0.10
124	600426	华鲁恒升	101,100	3,177,573.00	0.10
125	002080	中材科技	86,500	3,143,410.00	0.10
126	688150	莱特光电	115,918	3,133,263.54	0.10
127	605001	威奥股份	407,100	3,106,173.00	0.10
128	688655	迅捷兴	179,726	3,078,706.38	0.10
129	300683	海特生物	110,100	3,053,073.00	0.10
130	002999	天禾股份	425,100	2,903,433.00	0.09
131	300195	长荣股份	359,800	2,881,998.00	0.09
132	600875	东方电气	117,400	2,850,472.00	0.09
133	601336	新华保险	40,700	2,836,790.00	0.09

134	003027	同兴科技	125,700	2,803,110.00	0.09
135	000993	闽东电力	229,300	2,747,014.00	0.09
136	300405	科隆股份	424,600	2,708,948.00	0.09
137	600392	盛和资源	125,200	2,695,556.00	0.09
138	600346	恒力石化	116,000	2,613,480.00	0.08
139	601686	友发集团	414,400	2,602,432.00	0.08
140	603306	华懋科技	41,300	2,602,313.00	0.08
141	603729	龙韵股份	159,600	2,567,964.00	0.08
142	600549	厦门钨业	62,400	2,562,144.00	0.08
143	603700	宁水集团	188,000	2,554,920.00	0.08
144	000683	博源化工	339,000	2,522,160.00	0.08
145	000060	中金岭南	429,200	2,510,820.00	0.08
146	002333	罗普斯金	444,500	2,498,090.00	0.08
147	603188	亚邦股份	523,500	2,402,865.00	0.08
148	001209	洪兴股份	114,600	2,390,556.00	0.08
149	605066	天正电气	325,000	2,372,500.00	0.08
150	605567	春雪食品	215,200	2,367,200.00	0.08
151	002234	民和股份	271,200	2,337,744.00	0.08
152	301286	侨源股份	54,600	2,309,034.00	0.07
153	301051	信濠光电	117,000	2,293,200.00	0.07
154	000973	佛塑科技	154,200	2,266,740.00	0.07
155	600830	香溢融通	236,200	2,260,434.00	0.07
156	688280	精进电动	259,418	2,256,936.60	0.07
157	300435	中泰股份	100,700	2,237,554.00	0.07
158	600761	安徽合力	105,600	2,205,984.00	0.07
159	002022	科华生物	369,200	2,193,048.00	0.07
160	000720	新能泰山	666,800	2,180,436.00	0.07
161	603296	华勤技术	24,000	2,177,760.00	0.07
162	300381	溢多利	320,600	2,090,312.00	0.07
163	600579	中化装备	251,400	2,086,620.00	0.07
164	601009	南京银行	180,900	2,067,687.00	0.07
165	002297	博云新材	172,500	2,064,825.00	0.07
166	000893	亚钾国际	43,000	2,062,710.00	0.07
167	600348	华阳股份	247,900	2,047,654.00	0.07
168	688455	科捷智能	101,703	2,043,213.27	0.07
169	002632	道明光学	163,000	2,029,350.00	0.07
170	600467	好当家	776,600	2,019,160.00	0.07
171	600488	津药药业	490,200	2,004,918.00	0.06
172	000812	陕西金叶	417,600	1,996,128.00	0.06
173	002478	常宝股份	233,900	1,981,133.00	0.06
174	001205	盛航股份	115,400	1,973,340.00	0.06
175	001311	多利科技	61,300	1,966,504.00	0.06
176	601717	中创智领	80,100	1,966,455.00	0.06

177	601500	通用股份	407,700	1,965,114.00	0.06
178	301539	宏鑫科技	93,600	1,956,240.00	0.06
179	003042	中农联合	121,800	1,956,108.00	0.06
180	300723	一品红	57,800	1,939,190.00	0.06
181	000778	新兴铸管	461,400	1,928,652.00	0.06
182	301165	锐捷网络	21,700	1,926,960.00	0.06
183	000886	海南高速	278,100	1,907,766.00	0.06
184	605266	健之佳	98,000	1,883,560.00	0.06
185	600429	三元股份	360,800	1,868,944.00	0.06
186	601233	桐昆股份	108,400	1,865,564.00	0.06
187	603682	锦和商管	279,600	1,842,564.00	0.06
188	002381	双箭股份	273,800	1,804,342.00	0.06
189	301499	维科精密	60,700	1,786,401.00	0.06
190	603970	中农立华	138,300	1,778,538.00	0.06
191	603105	芯能科技	192,500	1,769,075.00	0.06
192	002968	新大正	144,700	1,759,552.00	0.06
193	002986	宇新股份	162,900	1,752,804.00	0.06
194	603519	立霸股份	145,700	1,752,771.00	0.06
195	603968	醋化股份	155,700	1,739,169.00	0.06
196	300771	智莱科技	111,300	1,725,150.00	0.06
197	600989	宝丰能源	87,800	1,723,514.00	0.06
198	000757	浩物股份	353,700	1,722,519.00	0.06
199	000932	华菱钢铁	306,300	1,721,406.00	0.06
200	601615	明阳智能	118,400	1,714,432.00	0.06
201	600415	小商品城	107,400	1,713,030.00	0.06
202	001366	播恩集团	128,000	1,711,360.00	0.06
203	601375	中原证券	394,900	1,698,070.00	0.05
204	601399	国机重装	352,000	1,682,560.00	0.05
205	603214	爱婴室	97,900	1,679,964.00	0.05
206	000153	丰原药业	267,500	1,677,225.00	0.05
207	600230	沧州大化	109,700	1,674,022.00	0.05
208	301519	舜禹股份	124,500	1,670,790.00	0.05
209	600969	郴电国际	162,600	1,663,398.00	0.05
210	002110	三钢闽光	359,900	1,579,961.00	0.05
211	000059	华锦股份	294,200	1,573,970.00	0.05
212	600808	马钢股份	366,300	1,545,786.00	0.05
213	300504	天邑股份	103,500	1,541,115.00	0.05
214	000333	美的集团	19,600	1,531,740.00	0.05
215	601003	柳钢股份	304,300	1,530,629.00	0.05
216	002582	好想你	136,000	1,502,800.00	0.05
217	000717	中南股份	578,300	1,497,797.00	0.05
218	603681	永冠新材	78,600	1,491,828.00	0.05
219	603096	新经典	84,200	1,466,764.00	0.05

220	603636	南威软件	123,200	1,458,688.00	0.05
221	002669	康达新材	95,900	1,457,680.00	0.05
222	688638	誉辰智能	40,026	1,454,144.58	0.05
223	301408	华人健康	78,200	1,451,392.00	0.05
224	603506	南都物业	111,100	1,450,966.00	0.05
225	000702	正虹科技	217,200	1,450,896.00	0.05
226	600697	欧亚集团	109,300	1,441,667.00	0.05
227	301060	兰卫医学	155,200	1,435,600.00	0.05
228	000919	金陵药业	180,200	1,432,590.00	0.05
229	603367	辰欣药业	82,700	1,432,364.00	0.05
230	300777	中简科技	35,100	1,432,080.00	0.05
231	300707	威唐工业	87,000	1,431,150.00	0.05
232	002910	庄园牧场	128,600	1,428,746.00	0.05
233	002008	大族激光	34,600	1,425,174.00	0.05
234	000887	中鼎股份	61,400	1,425,094.00	0.05
235	001216	华瓷股份	83,200	1,423,552.00	0.05
236	603385	惠达卫浴	208,100	1,423,404.00	0.05
237	002330	得利斯	294,000	1,422,960.00	0.05
238	600409	三友化工	228,400	1,413,796.00	0.05
239	000407	胜利股份	278,500	1,398,070.00	0.05
240	000681	视觉中国	58,500	1,392,885.00	0.05
241	300176	鸿特科技	207,700	1,385,359.00	0.04
242	603886	元祖股份	98,200	1,371,854.00	0.04
243	600312	平高电气	78,900	1,368,915.00	0.04
244	600935	华塑股份	557,800	1,366,610.00	0.04
245	603168	莎普爱思	181,900	1,338,784.00	0.04
246	600573	惠泉啤酒	111,800	1,333,774.00	0.04
247	300928	华安鑫创	42,800	1,333,220.00	0.04
248	300110	华仁药业	422,800	1,331,820.00	0.04
249	000599	青岛双星	196,000	1,297,520.00	0.04
250	603329	上海雅仕	116,900	1,285,900.00	0.04
251	300243	瑞丰高材	120,300	1,254,729.00	0.04
252	002414	高德红外	85,500	1,254,285.00	0.04
253	002367	康力电梯	153,400	1,236,404.00	0.04
254	301198	喜悦智行	97,100	1,219,576.00	0.04
255	600128	苏豪弘业	109,800	1,206,702.00	0.04
256	300694	蠡湖股份	98,500	1,189,880.00	0.04
257	301149	隆华新材	111,800	1,189,552.00	0.04
258	300416	苏试试验	66,500	1,186,360.00	0.04
259	603161	科华控股	86,300	1,184,899.00	0.04
260	002181	粤传媒	137,100	1,181,802.00	0.04
261	002760	凤形股份	54,300	1,178,853.00	0.04
262	000807	云铝股份	35,700	1,172,388.00	0.04

263	600354	敦煌种业	181,200	1,172,364.00	0.04
264	000829	天音控股	107,400	1,171,734.00	0.04
265	600372	中航机载	87,300	1,171,566.00	0.04
266	002694	顾地科技	309,500	1,163,720.00	0.04
267	001313	粤海饲料	158,700	1,161,684.00	0.04
268	301166	优宁维	38,900	1,154,552.00	0.04
269	300447	全信股份	63,800	1,153,504.00	0.04
270	000411	英特集团	90,400	1,152,600.00	0.04
271	600127	金健米业	171,500	1,152,480.00	0.04
272	002539	云图控股	97,500	1,152,450.00	0.04
273	600327	大东方	231,900	1,147,905.00	0.04
274	300664	鹏鹞环保	214,100	1,147,576.00	0.04
275	002404	嘉欣丝绸	163,700	1,147,537.00	0.04
276	002476	宝莫股份	158,000	1,143,920.00	0.04
277	603390	通达电气	87,500	1,143,625.00	0.04
278	002443	金洲管道	139,800	1,140,768.00	0.04
279	000709	河钢股份	493,400	1,139,754.00	0.04
280	002671	龙泉股份	217,200	1,138,128.00	0.04
281	300056	中创环保	138,400	1,137,648.00	0.04
282	301361	众智科技	34,900	1,137,391.00	0.04
283	300304	云意电气	97,600	1,136,064.00	0.04
284	301088	戎美股份	66,200	1,135,330.00	0.04
285	603396	金辰股份	33,800	1,133,990.00	0.04
286	300112	万讯自控	131,500	1,132,215.00	0.04
287	000751	锌业股份	274,300	1,121,887.00	0.04
288	600578	京能电力	219,700	1,120,470.00	0.04
289	002317	众生药业	58,700	1,114,126.00	0.04
290	301279	金道科技	31,900	1,103,740.00	0.04
291	600027	华电国际	221,800	1,100,128.00	0.04
292	002396	星网锐捷	36,300	1,099,890.00	0.04
293	300838	浙江力诺	72,100	1,099,525.00	0.04
294	000917	电广传媒	106,600	1,095,848.00	0.04
295	688231	隆达股份	42,085	1,094,210.00	0.04
296	301529	福赛科技	9,600	1,085,760.00	0.04
297	603708	家家悦	91,700	1,084,811.00	0.04
298	605117	德业股份	12,400	1,068,880.00	0.03
299	002321	华英农业	458,500	1,054,550.00	0.03
300	002540	亚太科技	146,700	1,038,636.00	0.03
301	600814	杭州解百	125,500	1,016,550.00	0.03
302	605162	新中港	118,800	1,014,552.00	0.03
303	002363	隆基机械	99,900	1,008,990.00	0.03
304	601100	恒立液压	9,100	1,000,181.00	0.03
305	002746	仙坛股份	162,700	987,589.00	0.03

306	002666	德联集团	179,100	986,841.00	0.03
307	600644	乐山电力	100,100	975,975.00	0.03
308	600853	龙建股份	225,300	975,549.00	0.03
309	002661	克明食品	106,700	975,238.00	0.03
310	000421	南京公用	140,300	969,473.00	0.03
311	600725	云维股份	230,800	964,744.00	0.03
312	002845	同兴达	68,500	963,795.00	0.03
313	301032	新柴股份	80,000	962,400.00	0.03
314	600333	长春燃气	173,000	956,690.00	0.03
315	002331	皖通科技	104,600	933,032.00	0.03
316	300929	华骐环保	85,700	921,275.00	0.03
317	300278	华昌达	150,100	915,610.00	0.03
318	301089	拓新药业	32,700	915,600.00	0.03
319	600686	金龙汽车	51,600	915,384.00	0.03
320	301049	超越科技	42,500	912,900.00	0.03
321	301212	联盛化学	30,400	910,784.00	0.03
322	002391	长青股份	152,500	904,325.00	0.03
323	002204	大连重工	118,200	904,230.00	0.03
324	605299	舒华体育	78,600	903,114.00	0.03
325	002284	亚太股份	60,300	900,279.00	0.03
326	002608	江苏国信	121,400	897,146.00	0.03
327	603759	海天股份	84,500	890,630.00	0.03
328	600981	苏豪汇鸿	283,600	890,504.00	0.03
329	300787	海能实业	75,700	889,475.00	0.03
330	601368	绿城水务	179,000	887,840.00	0.03
331	600097	开创国际	78,100	887,216.00	0.03
332	603712	七一二	42,600	884,802.00	0.03
333	000626	远大控股	111,500	884,195.00	0.03
334	688602	康鹏科技	101,536	881,332.48	0.03
335	603200	上海洗霸	12,300	875,022.00	0.03
336	002810	山东赫达	58,900	873,487.00	0.03
337	001217	华尔泰	62,800	872,920.00	0.03
338	002976	瑞玛精密	31,100	871,733.00	0.03
339	300106	西部牧业	81,000	870,750.00	0.03
340	002734	利民股份	54,600	870,324.00	0.03
341	603126	中材节能	129,200	868,224.00	0.03
342	002614	奥佳华	118,700	867,697.00	0.03
343	300839	博汇股份	72,000	866,880.00	0.03
344	000798	中水渔业	81,900	866,502.00	0.03
345	000586	汇源通信	63,900	864,567.00	0.03
346	600847	万里股份	74,300	863,366.00	0.03
347	002877	智能自控	93,900	862,002.00	0.03
348	002758	浙农股份	85,600	861,992.00	0.03

349	002537	海联金汇	95,100	861,606.00	0.03
350	601231	环旭电子	28,700	861,000.00	0.03
351	600986	浙文互联	110,100	860,982.00	0.03
352	002301	齐心集团	112,100	860,928.00	0.03
353	002554	惠博普	269,800	860,662.00	0.03
354	688199	久日新材	36,511	860,564.27	0.03
355	603979	金诚信	11,300	860,495.00	0.03
356	603977	国泰集团	61,700	857,630.00	0.03
357	600222	太龙药业	130,200	856,716.00	0.03
358	600561	江西长运	132,200	856,656.00	0.03
359	301118	恒光股份	34,500	854,220.00	0.03
360	000985	大庆华科	44,700	854,217.00	0.03
361	600859	王府井	55,000	854,150.00	0.03
362	002763	汇洁股份	118,300	854,126.00	0.03
363	300172	中电环保	156,700	854,015.00	0.03
364	003003	天元股份	64,600	854,012.00	0.03
365	600023	浙能电力	172,400	853,380.00	0.03
366	002905	金逸影视	75,500	853,150.00	0.03
367	002398	垒知集团	151,800	853,116.00	0.03
368	000695	滨海能源	67,100	852,841.00	0.03
369	688439	振华风光	13,196	852,461.60	0.03
370	000936	华西股份	103,400	850,982.00	0.03
371	002830	名雕股份	43,600	850,200.00	0.03
372	002887	绿茵生态	90,700	848,952.00	0.03
373	601996	丰林集团	376,900	848,025.00	0.03
374	002551	尚荣医疗	231,000	843,150.00	0.03
375	300970	华绿生物	41,100	842,961.00	0.03
376	002921	联诚精密	49,400	840,788.00	0.03
377	000911	广农糖业	114,600	837,726.00	0.03
378	600078	澄星股份	87,300	837,207.00	0.03
379	002726	龙大美食	203,400	835,974.00	0.03
380	600515	海南机场	156,800	835,744.00	0.03
381	600681	百川能源	193,200	834,624.00	0.03
382	600858	银座股份	133,400	833,750.00	0.03
383	603022	新通联	80,900	830,843.00	0.03
384	002984	森麒麟	39,100	827,747.00	0.03
385	600159	大龙地产	291,200	806,624.00	0.03
386	600598	北大荒	53,000	792,350.00	0.03
387	002601	龙佰集团	40,200	787,116.00	0.03
388	300868	杰美特	24,600	779,820.00	0.03
389	603327	福蓉科技	71,300	774,318.00	0.03
390	600300	维维股份	219,400	770,094.00	0.02
391	002686	亿利达	111,000	725,940.00	0.02

392	603999	读者传媒	102,200	718,466.00	0.02
393	000713	国投丰乐	107,300	710,326.00	0.02
394	002967	广电计量	31,900	702,119.00	0.02
395	601609	金田股份	64,800	699,840.00	0.02
396	600284	浦东建设	82,700	694,680.00	0.02
397	002906	华阳集团	22,600	691,108.00	0.02
398	001319	铭科精技	25,000	686,750.00	0.02
399	002745	木林森	71,300	682,341.00	0.02
400	603982	泉峰汽车	81,500	682,155.00	0.02
401	688257	新锐股份	19,672	674,356.16	0.02
402	601366	利群股份	137,800	672,464.00	0.02
403	603711	香飘飘	48,000	644,640.00	0.02
404	002653	海思科	12,300	631,236.00	0.02
405	002659	凯文教育	106,800	625,848.00	0.02
406	002238	天威视讯	76,700	623,571.00	0.02
407	001387	雪祺电气	44,800	619,136.00	0.02
408	300936	中英科技	15,800	616,200.00	0.02
409	002664	信质集团	25,400	608,584.00	0.02
410	002445	中南文化	233,900	608,140.00	0.02
411	300713	英可瑞	35,100	607,230.00	0.02
412	000758	中色股份	91,100	604,904.00	0.02
413	300129	泰胜风能	57,800	604,588.00	0.02
414	001218	丽臣实业	26,400	601,392.00	0.02
415	301170	锡南科技	21,500	600,925.00	0.02
416	002090	金智科技	50,700	598,260.00	0.02
417	600596	新安股份	52,100	597,587.00	0.02
418	600015	华夏银行	86,800	596,316.00	0.02
419	603006	黎明股份	45,400	595,648.00	0.02
420	301216	万凯新材	35,300	595,158.00	0.02
421	002732	燕塘乳业	34,900	593,998.00	0.02
422	688355	明志科技	33,335	593,363.00	0.02
423	301223	中荣股份	32,300	593,351.00	0.02
424	603856	东宏股份	47,500	592,325.00	0.02
425	603967	中创物流	43,100	591,763.00	0.02
426	002201	九鼎新材	51,600	589,272.00	0.02
427	300425	中建环能	118,800	588,060.00	0.02
428	300514	友讯达	44,400	586,524.00	0.02
429	002852	道道全	55,500	585,525.00	0.02
430	603029	天鹅股份	32,100	585,504.00	0.02
431	002587	奥拓电子	86,500	584,740.00	0.02
432	002282	博深股份	79,500	584,325.00	0.02
433	300851	交大思诺	21,800	584,022.00	0.02
434	603167	渤海轮渡	61,700	581,831.00	0.02

435	002998	优彩资源	77,000	581,350.00	0.02
436	600982	宁波能源	133,900	581,126.00	0.02
437	601519	大智慧	45,000	579,150.00	0.02
438	002318	久立特材	20,000	579,000.00	0.02
439	603085	天成自控	48,800	578,280.00	0.02
440	300214	日科化学	86,500	577,820.00	0.02
441	000707	双环科技	95,500	577,775.00	0.02
442	603709	中源家居	35,400	577,728.00	0.02
443	002783	凯龙股份	60,300	577,071.00	0.02
444	300387	富邦科技	67,700	576,127.00	0.02
445	000065	北方国际	46,200	575,652.00	0.02
446	002835	同为股份	35,100	574,938.00	0.02
447	603810	丰山集团	36,000	574,920.00	0.02
448	002239	奥特佳	192,900	574,842.00	0.02
449	605108	同庆楼	29,900	574,678.00	0.02
450	603190	亚通精工	21,300	574,461.00	0.02
451	300883	龙利得	85,100	574,425.00	0.02
452	000822	山东海化	109,400	574,350.00	0.02
453	600992	贵绳股份	42,300	574,011.00	0.02
454	000659	珠海中富	141,200	573,272.00	0.02
455	600470	六国化工	95,800	572,884.00	0.02
456	301116	益客食品	52,400	572,732.00	0.02
457	600792	云煤能源	147,600	572,688.00	0.02
458	605399	晨光新材	42,300	571,896.00	0.02
459	603231	索宝蛋白	31,200	571,584.00	0.02
460	301176	逸豪新材	22,700	571,359.00	0.02
461	603221	爱丽家居	43,600	571,160.00	0.02
462	002863	今飞凯达	97,300	571,151.00	0.02
463	002346	柘中股份	28,100	570,711.00	0.02
464	300985	致远新能	31,100	570,685.00	0.02
465	603819	神力股份	47,000	570,580.00	0.02
466	002790	瑞尔特	68,000	570,520.00	0.02
467	000605	渤海股份	85,000	570,350.00	0.02
468	002687	乔治白	118,300	570,206.00	0.02
469	300625	三雄极光	48,100	569,985.00	0.02
470	600728	佳都科技	85,300	569,804.00	0.02
471	600233	圆通速递	34,700	569,774.00	0.02
472	603150	万朗磁塑	15,000	569,700.00	0.02
473	600785	新华百货	42,000	569,100.00	0.02
474	002386	天原股份	104,800	569,064.00	0.02
475	603867	新化股份	22,400	568,960.00	0.02
476	603116	红蜻蜓	92,800	568,864.00	0.02
477	002603	以岭药业	33,300	568,431.00	0.02

478	300375	鹏翎股份	108,000	568,080.00	0.02
479	688510	航亚科技	21,083	567,132.70	0.02
480	300535	达威股份	31,600	564,376.00	0.02
481	002919	名臣健康	24,500	563,255.00	0.02
482	601678	滨化股份	132,800	563,072.00	0.02
483	300989	蕾奥规划	31,900	563,035.00	0.02
484	301225	恒勃股份	3,400	562,700.00	0.02
485	001296	长江材料	21,400	562,178.00	0.02
486	603882	金域医学	19,800	561,528.00	0.02
487	603585	苏利股份	29,700	560,142.00	0.02
488	000686	东北证券	60,000	559,200.00	0.02
489	300973	立高食品	13,000	559,000.00	0.02
490	002913	奥士康	13,000	555,620.00	0.02
491	300583	赛托生物	40,500	554,445.00	0.02
492	300639	凯普生物	103,000	554,140.00	0.02
493	603117	万林物流	117,200	553,184.00	0.02
494	300099	尤洛卡	73,400	552,702.00	0.02
495	605055	迎丰股份	56,900	552,499.00	0.02
496	600399	抚顺特钢	94,600	552,464.00	0.02
497	600955	维远股份	34,100	552,420.00	0.02
498	301278	快可电子	16,500	551,595.00	0.02
499	002356	赫美集团	139,200	551,232.00	0.02
500	688056	莱伯泰科	16,320	548,515.20	0.02
501	002150	正泰电源	27,200	546,720.00	0.02
502	301069	凯盛新材	19,500	542,100.00	0.02
503	601969	海南矿业	45,600	541,728.00	0.02
504	301370	国科恒泰	46,300	540,784.00	0.02
505	600406	国电南瑞	24,000	539,520.00	0.02
506	300497	富祥药业	35,500	536,405.00	0.02
507	603392	万泰生物	11,900	534,786.00	0.02
508	688115	思林杰	8,112	531,984.96	0.02
509	002419	天虹股份	95,800	529,774.00	0.02
510	600329	达仁堂	11,600	529,192.00	0.02
511	688153	唯捷创芯	13,998	526,884.72	0.02
512	600316	洪都航空	15,000	523,650.00	0.02
513	002037	保利联合	54,800	520,600.00	0.02
514	688021	奥福科技	28,263	518,626.05	0.02
515	001338	永顺泰	42,400	513,464.00	0.02
516	000881	中广核技	56,300	509,515.00	0.02
517	002152	广电运通	36,800	508,208.00	0.02
518	600862	中航高科	21,300	503,319.00	0.02
519	301273	瑞晨环保	19,000	503,310.00	0.02
520	600713	南京医药	91,700	500,682.00	0.02

521	000589	贵州轮胎	92,700	480,186.00	0.02
522	688586	江航装备	36,167	471,617.68	0.02
523	300596	利安隆	11,100	468,531.00	0.02
524	600063	皖维高新	78,300	461,187.00	0.01
525	600888	新疆众和	56,000	458,640.00	0.01
526	605377	华旺科技	53,000	452,620.00	0.01
527	600966	博汇纸业	66,200	452,146.00	0.01
528	002511	中顺洁柔	52,500	449,400.00	0.01
529	603129	春风动力	1,600	445,888.00	0.01
530	600897	厦门空港	25,900	445,480.00	0.01
531	001378	德冠新材	18,800	443,304.00	0.01
532	002803	吉宏股份	26,700	436,812.00	0.01
533	000718	苏宁环球	188,600	431,894.00	0.01
534	605179	一鸣食品	20,600	430,746.00	0.01
535	301106	骏成科技	14,400	428,688.00	0.01
536	603081	大丰实业	30,500	427,915.00	0.01
537	601608	中信重工	64,600	425,714.00	0.01
538	688600	皖仪科技	16,859	422,317.95	0.01
539	002093	国脉科技	36,300	417,450.00	0.01
540	603041	美思德	34,500	415,725.00	0.01
541	002314	南山控股	145,500	414,675.00	0.01
542	300837	浙矿股份	11,900	404,838.00	0.01
543	601010	文峰股份	146,700	400,491.00	0.01
544	603777	来伊份	29,000	398,170.00	0.01
545	001368	通达创智	16,000	393,280.00	0.01
546	002328	新朋股份	59,200	391,312.00	0.01
547	001215	千味央厨	10,100	388,850.00	0.01
548	600361	创新新材	91,700	388,808.00	0.01
549	603818	曲美家居	107,400	387,714.00	0.01
550	600252	中恒集团	141,000	386,340.00	0.01
551	002677	浙江美大	46,100	384,935.00	0.01
552	300927	江天化学	16,500	384,615.00	0.01
553	000850	华茂股份	70,300	384,541.00	0.01
554	601001	晋控煤业	29,100	382,665.00	0.01
555	002312	川发龙蟒	35,000	382,550.00	0.01
556	603909	建发合诚	33,800	381,602.00	0.01
557	600620	天宸股份	58,300	378,950.00	0.01
558	601388	怡球资源	125,700	378,357.00	0.01
559	002203	海亮股份	29,400	372,204.00	0.01
560	300428	立中集团	15,900	371,265.00	0.01
561	600618	氯碱化工	30,900	367,092.00	0.01
562	601999	出版传媒	53,300	366,171.00	0.01
563	301090	华润材料	51,500	362,560.00	0.01

564	002166	莱茵生物	42,800	361,660.00	0.01
565	600099	林海股份	34,100	356,345.00	0.01
566	301135	瑞德智能	12,500	351,250.00	0.01
567	688370	从麟科技	14,320	348,978.40	0.01
568	301083	百胜智能	18,400	347,944.00	0.01
569	603937	丽岛新材	28,800	345,312.00	0.01
570	603065	宿迁联盛	41,100	341,541.00	0.01
571	603080	新疆火炬	14,100	333,042.00	0.01
572	300523	辰安科技	13,900	332,627.00	0.01
573	002012	凯恩股份	50,300	324,435.00	0.01
574	301320	豪江智能	19,100	324,127.00	0.01
575	600876	凯盛新能	32,600	321,436.00	0.01
576	300349	金卡智能	20,400	318,852.00	0.01
577	000035	中国天楹	57,400	316,848.00	0.01
578	603648	畅联股份	29,000	316,100.00	0.01
579	002820	桂发祥	26,100	314,505.00	0.01
580	300780	德恩精工	16,300	314,264.00	0.01
581	002548	金新农	51,600	313,728.00	0.01
582	600195	中牧股份	39,800	313,226.00	0.01
583	002382	蓝帆医疗	55,800	312,480.00	0.01
584	603915	国茂股份	16,900	311,129.00	0.01
585	300187	永清环保	63,100	307,297.00	0.01
586	300599	雄塑科技	37,600	306,440.00	0.01
587	301565	中仑新材	12,600	304,164.00	0.01
588	603788	宁波高发	18,600	303,924.00	0.01
589	301502	华阳智能	6,800	303,824.00	0.01
590	000715	中兴商业	48,100	302,549.00	0.01
591	301518	长华化学	8,500	302,345.00	0.01
592	300201	海伦哲	44,100	301,203.00	0.01
593	301571	国科天成	5,200	299,936.00	0.01
594	605158	华达新材	37,300	299,892.00	0.01
595	603639	海利尔	23,600	299,720.00	0.01
596	002698	博实股份	17,800	299,218.00	0.01
597	300719	安达维尔	16,500	298,815.00	0.01
598	688395	正弦电气	12,285	298,771.20	0.01
599	605020	永和股份	11,100	298,479.00	0.01
600	603768	常青股份	25,700	298,120.00	0.01
601	003018	金富科技	17,100	297,882.00	0.01
602	600148	长春一东	15,200	297,464.00	0.01
603	300281	金明精机	36,400	297,388.00	0.01
604	603507	振江股份	11,300	297,303.00	0.01
605	603578	三星新材	24,600	297,168.00	0.01
606	600319	亚星化学	32,000	296,960.00	0.01

607	002933	新兴装备	8,200	296,840.00	0.01
608	301296	新巨丰	34,800	296,496.00	0.01
609	300864	南大环境	15,000	295,800.00	0.01
610	603860	中公高科	9,800	295,666.00	0.01
611	300275	梅安森	22,200	295,482.00	0.01
612	300148	天舟文化	67,300	295,447.00	0.01
613	301378	通达海	10,400	295,360.00	0.01
614	301158	德石股份	13,200	295,284.00	0.01
615	605218	伟时电子	16,000	295,200.00	0.01
616	002972	科安达	24,700	295,165.00	0.01
617	002337	赛象科技	44,900	294,993.00	0.01
618	300692	中赋科技	35,100	294,840.00	0.01
619	601865	福莱特	18,800	294,596.00	0.01
620	600126	杭钢股份	36,100	294,576.00	0.01
621	603677	奇精机械	16,200	294,516.00	0.01
622	002753	永东股份	41,300	294,469.00	0.01
623	301298	东利机械	18,600	294,252.00	0.01
624	001230	劲旅环境	13,500	294,165.00	0.01
625	002995	天地在线	17,800	294,056.00	0.01
626	600523	贵航股份	18,700	293,777.00	0.01
627	688026	洁特生物	18,216	293,459.76	0.01
628	300800	力合科技	25,200	293,076.00	0.01
629	001201	东瑞股份	20,100	292,857.00	0.01
630	603002	宏昌电子	39,600	292,644.00	0.01
631	301429	森泰股份	15,400	292,600.00	0.01
632	301356	天振股份	13,800	292,422.00	0.01
633	605222	起帆电缆	15,900	292,401.00	0.01
634	301103	何氏眼科	14,900	292,338.00	0.01
635	301037	保立佳	20,300	292,320.00	0.01
636	301503	智迪科技	8,100	292,086.00	0.01
637	002099	海翔药业	46,800	292,032.00	0.01
638	301006	迈拓股份	17,700	291,873.00	0.01
639	002062	宏润建设	31,500	291,375.00	0.01
640	300784	利安科技	5,800	291,276.00	0.01
641	003011	海象新材	13,200	290,928.00	0.01
642	001229	魅视科技	6,700	290,914.00	0.01
643	603211	晋拓股份	12,900	290,895.00	0.01
644	301276	嘉曼服饰	9,700	290,806.00	0.01
645	301588	美新科技	16,000	290,720.00	0.01
646	301360	荣旗科技	4,100	290,690.00	0.01
647	000006	深振业 A	29,200	290,540.00	0.01
648	000563	陕国投 A	84,200	290,490.00	0.01
649	603066	音飞储存	27,000	290,250.00	0.01

650	600838	上海九百	26,800	289,976.00	0.01
651	600586	金晶科技	51,500	289,945.00	0.01
652	603533	掌阅科技	13,100	289,772.00	0.01
653	300939	秋田微	8,400	289,632.00	0.01
654	002566	益盛药业	37,900	289,177.00	0.01
655	000565	渝三峡 A	39,600	289,080.00	0.01
656	301515	港通医疗	14,400	288,864.00	0.01
657	603218	日月股份	21,800	288,850.00	0.01
658	603898	好莱客	21,700	288,827.00	0.01
659	300977	深圳瑞捷	16,800	288,792.00	0.01
660	002394	联发股份	18,200	288,652.00	0.01
661	000888	峨眉山 A	22,000	288,640.00	0.01
662	002574	明牌珠宝	51,300	288,306.00	0.01
663	002533	金杯电工	23,100	288,288.00	0.01
663	601113	华鼎股份	61,600	288,288.00	0.01
664	300500	启迪设计	20,800	288,080.00	0.01
665	301222	浙江恒威	10,100	288,052.00	0.01
666	002452	长高电新	35,000	288,050.00	0.01
667	301587	中瑞股份	12,300	287,820.00	0.01
668	300700	岱勒新材	23,300	287,755.00	0.01
669	600101	明星电力	31,100	287,675.00	0.01
670	002631	德尔未来	48,100	287,638.00	0.01
671	603836	海程邦达	20,900	287,584.00	0.01
672	600108	亚盛集团	91,200	287,280.00	0.01
672	603958	哈森股份	21,600	287,280.00	0.01
673	000789	万年青	54,900	287,127.00	0.01
674	001896	豫能控股	55,200	287,040.00	0.01
674	002793	罗欣药业	59,800	287,040.00	0.01
675	600774	汉商集团	31,400	286,996.00	0.01
676	002209	达意隆	17,800	286,936.00	0.01
677	603237	五芳斋	17,200	286,896.00	0.01
678	601599	浙文影业	72,000	286,560.00	0.01
679	605388	均瑶健康	38,500	286,440.00	0.01
680	002935	天奥电子	12,800	286,080.00	0.01
681	300749	顶固集创	23,700	286,059.00	0.01
681	600679	上海凤凰	21,300	286,059.00	0.01
682	301231	荣信文化	9,200	285,936.00	0.01
683	300318	博晖创新	45,600	285,912.00	0.01
684	000523	红棉股份	75,787	285,716.99	0.01
685	002568	百润股份	13,100	285,711.00	0.01
686	603121	华培动力	13,500	285,660.00	0.01
687	000722	湖南发展	24,200	285,560.00	0.01
687	600281	华阳新材	48,400	285,560.00	0.01

688	002033	丽江股份	31,200	285,480.00	0.01
689	301469	恒达新材	9,400	285,478.00	0.01
690	002668	TCL 智家	27,500	285,450.00	0.01
691	002172	澳洋健康	71,900	285,443.00	0.01
692	603808	歌力思	33,500	285,420.00	0.01
693	603379	三美股份	4,700	285,384.00	0.01
694	002174	游族网络	23,300	285,192.00	0.01
695	301126	达嘉维康	23,200	285,128.00	0.01
696	605287	德才股份	11,000	285,120.00	0.01
697	002492	恒基达鑫	32,600	284,924.00	0.01
698	601015	陕西黑猫	78,700	284,894.00	0.01
699	600778	友好集团	42,700	284,809.00	0.01
700	000561	烽火电子	23,300	284,726.00	0.01
701	301193	家联科技	13,200	284,724.00	0.01
702	002983	芯瑞达	12,400	284,580.00	0.01
703	603817	海峡环保	40,100	284,309.00	0.01
704	002888	惠威科技	14,500	284,055.00	0.01
705	603313	梦百合	31,900	283,910.00	0.01
706	002787	华源控股	22,800	283,860.00	0.01
707	300005	探路者	26,200	283,746.00	0.01
708	301355	南王科技	21,300	283,716.00	0.01
709	605500	森林包装	31,700	283,715.00	0.01
710	301365	矩阵股份	11,900	283,696.00	0.01
711	301111	粤万年青	14,900	283,547.00	0.01
712	300743	天地数码	12,700	283,464.00	0.01
713	301026	浩通科技	10,000	283,400.00	0.01
714	600506	统一股份	10,800	283,068.00	0.01
715	300239	东宝生物	48,300	283,038.00	0.01
716	603311	金海高科	18,500	282,680.00	0.01
717	002225	濮耐股份	49,500	282,150.00	0.01
718	002773	康弘药业	9,400	281,718.00	0.01
719	300982	苏文电能	13,900	280,641.00	0.01
720	600736	苏州高新	41,500	280,540.00	0.01
721	603266	天龙股份	12,300	279,948.00	0.01
722	300673	佩蒂股份	15,600	279,708.00	0.01
723	301631	壹连科技	2,700	279,585.00	0.01
724	603155	新亚强	16,300	279,219.00	0.01
725	002644	佛慈制药	32,300	279,072.00	0.01
726	603008	喜临门	13,600	278,528.00	0.01
727	002497	雅化集团	11,200	277,200.00	0.01
728	301345	涛涛车业	1,100	276,452.00	0.01
729	300509	新美星	21,500	276,060.00	0.01
730	300993	玉马科技	18,650	274,528.00	0.01

731	301397	溯联股份	7,800	271,674.00	0.01
732	000998	隆平高科	29,000	271,440.00	0.01
733	600218	全柴动力	26,400	271,392.00	0.01
734	002643	万润股份	18,000	269,820.00	0.01
735	600323	瀚蓝环境	9,200	263,120.00	0.01
736	600158	中体产业	29,800	260,154.00	0.01
737	002807	江阴银行	56,800	259,576.00	0.01
738	000050	深天马 A	28,500	257,355.00	0.01
739	603877	太平鸟	17,700	257,181.00	0.01
740	301039	中集车辆	28,100	257,115.00	0.01
741	002955	鸿合科技	8,400	254,268.00	0.01
742	600968	海油发展	66,200	254,208.00	0.01
743	688244	永信至诚	10,126	247,479.44	0.01
744	001299	美能能源	16,510	242,862.10	0.01
745	002624	完美世界	14,600	239,294.00	0.01
746	000990	诚志股份	29,300	232,056.00	0.01
747	301399	英特科技	11,800	230,336.00	0.01
748	600510	黑牡丹	27,300	229,047.00	0.01
749	605339	南侨食品	11,600	227,592.00	0.01
750	002648	卫星化学	12,800	226,304.00	0.01
751	002438	江苏神通	14,100	224,190.00	0.01
752	000415	渤海租赁	55,300	223,965.00	0.01
753	002489	浙江永强	57,000	218,310.00	0.01
754	000598	兴蓉环境	29,400	210,798.00	0.01
755	601058	赛轮轮胎	13,000	210,340.00	0.01
756	000967	盈峰环境	28,200	206,988.00	0.01
757	000058	深赛格	21,900	205,860.00	0.01
758	002670	国盛证券	11,900	200,396.00	0.01
759	000419	通程控股	31,300	200,007.00	0.01
760	600328	中盐化工	24,000	197,760.00	0.01
761	002563	森马服饰	35,800	194,036.00	0.01
762	600135	乐凯胶片	18,800	194,016.00	0.01
763	002226	江南化工	32,600	189,406.00	0.01
764	002127	南极电商	56,200	189,394.00	0.01
765	600163	中闽能源	33,500	181,570.00	0.01
766	603280	南方路机	4,800	179,520.00	0.01
767	000957	中通客车	15,300	174,726.00	0.01
768	301551	无线传媒	5,500	173,525.00	0.01
769	600285	羚锐制药	8,300	171,893.00	0.01
770	600184	光电股份	9,000	171,540.00	0.01
771	605060	联德股份	4,500	166,320.00	0.01
772	300876	蒙泰高新	4,600	162,242.00	0.01
773	002755	奥赛康	9,700	158,401.00	0.01

774	601226	华电科工	20,000	156,800.00	0.01
775	600166	福田汽车	53,200	155,344.00	0.01
776	002075	沙钢股份	27,000	155,250.00	0.01
777	601579	会稽山	7,600	154,052.00	0.00
778	600458	时代新材	11,300	149,951.00	0.00
779	600998	九州通	28,900	147,968.00	0.00
780	603619	中曼石油	6,400	147,520.00	0.00
781	600496	精工钢构	31,700	131,555.00	0.00
782	600444	国机通用	7,100	130,143.00	0.00
783	000819	岳阳兴长	8,000	129,840.00	0.00
784	688106	金宏气体	6,620	129,685.80	0.00
785	002572	索菲亚	9,500	129,295.00	0.00
786	603203	快克智能	3,500	128,135.00	0.00
787	001211	双枪科技	4,800	126,912.00	0.00
788	688176	亚虹医药	10,852	124,906.52	0.00
789	600803	新奥股份	6,000	124,560.00	0.00
790	601007	金陵饭店	15,900	124,179.00	0.00
791	002846	英联股份	7,500	121,050.00	0.00
792	605116	奥锐特	4,800	120,240.00	0.00
793	002658	雪迪龙	13,100	118,293.00	0.00
794	002589	瑞康医药	35,600	114,632.00	0.00
795	002390	信邦制药	35,500	114,310.00	0.00
796	000429	粤高速 A	9,700	114,266.00	0.00
797	603995	甬金股份	6,300	113,904.00	0.00
798	000513	丽珠集团	3,300	113,718.00	0.00
799	003023	彩虹集团	5,000	113,300.00	0.00
800	002242	九阳股份	10,800	112,752.00	0.00
801	000927	中国铁物	43,100	112,491.00	0.00
802	603866	桃李面包	21,200	111,512.00	0.00
803	002385	大北农	27,500	110,000.00	0.00
804	603917	合力科技	7,400	109,446.00	0.00
805	603209	兴通股份	7,100	107,565.00	0.00
806	300519	新光药业	7,200	107,280.00	0.00
807	601187	厦门银行	14,600	107,164.00	0.00
808	603368	柳药集团	5,900	105,138.00	0.00
809	301148	嘉戎技术	2,200	104,610.00	0.00
810	301507	民生健康	6,700	102,912.00	0.00
811	600826	兰生股份	9,500	100,130.00	0.00
812	603180	金牌家居	4,900	99,911.00	0.00
813	301305	朗坤科技	4,400	98,868.00	0.00
814	688639	华恒生物	2,989	97,381.62	0.00
815	002483	润邦股份	13,600	97,104.00	0.00
816	600851	海欣股份	14,100	96,303.00	0.00

817	301028	鼎熔岩	6,600	96,228.00	0.00
818	603156	养元饮品	3,300	94,875.00	0.00
819	603187	海容冷链	5,900	92,571.00	0.00
820	600461	洪城环境	9,900	91,773.00	0.00
821	300871	回盛生物	4,400	91,212.00	0.00
822	002069	獐子岛	24,300	90,639.00	0.00
823	603687	大胜达	9,400	89,582.00	0.00
824	002481	双塔食品	16,600	84,826.00	0.00
825	002557	洽洽食品	3,800	82,156.00	0.00
826	600750	华润江中	3,500	81,095.00	0.00
827	002133	广宇集团	23,400	79,326.00	0.00
828	603897	长城科技	2,900	78,880.00	0.00
829	600033	福建高速	18,400	75,992.00	0.00
830	002358	森源电气	14,000	75,880.00	0.00
831	001286	陕西能源	7,900	73,549.00	0.00
832	002186	全聚德	6,100	71,858.00	0.00
833	300737	科顺股份	13,000	71,500.00	0.00
834	600572	康恩贝	16,000	71,360.00	0.00
835	688550	瑞联新材	1,559	70,638.29	0.00
836	600313	农发种业	10,800	69,552.00	0.00
837	603579	荣泰健康	2,900	69,049.00	0.00
838	301185	鸥玛软件	3,600	68,760.00	0.00
839	002662	峰璟股份	16,900	67,938.00	0.00
840	301335	天元宠物	2,000	57,680.00	0.00
841	002556	辉隆股份	9,400	56,776.00	0.00
842	300138	晨光生物	4,400	54,604.00	0.00
843	000862	银星能源	9,200	53,728.00	0.00
844	002221	东华能源	6,500	52,650.00	0.00
845	300369	绿盟科技	7,000	52,360.00	0.00
846	600611	大众交通	9,400	51,324.00	0.00
847	605337	李子园	4,000	47,560.00	0.00
848	603324	盛剑科技	1,700	42,109.00	0.00
849	601666	平煤股份	4,900	38,563.00	0.00
850	300481	濮阳惠成	1,700	26,350.00	0.00
851	603600	永艺股份	2,100	24,927.00	0.00
852	601619	嘉泽新能	5,100	22,644.00	0.00
853	603323	苏农银行	3,500	17,675.00	0.00
854	603097	江苏华辰	600	17,040.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	300274	阳光电源	182,681,271.56	17.85
2	300033	同花顺	144,403,176.95	14.11
3	300014	亿纬锂能	142,407,640.59	13.92
4	300308	中际旭创	141,068,361.72	13.79
5	002475	立讯精密	134,209,804.00	13.12
6	603986	兆易创新	127,236,121.25	12.43
7	300476	胜宏科技	125,997,758.89	12.31
8	002384	东山精密	123,294,477.45	12.05
9	601012	隆基绿能	106,294,238.32	10.39
10	600089	特变电工	104,882,539.95	10.25
11	000063	中兴通讯	100,822,376.45	9.85
12	002709	天赐材料	93,975,319.18	9.18
13	601328	交通银行	91,948,130.00	8.99
14	000333	美的集团	90,783,781.72	8.87
15	002241	歌尔股份	81,998,932.82	8.01
16	600941	中国移动	81,873,605.60	8.00
17	002463	沪电股份	81,692,683.88	7.98
18	300750	宁德时代	80,729,123.03	7.89
19	002466	天齐锂业	80,456,429.64	7.86
20	603799	华友钴业	80,324,352.52	7.85
21	600438	通威股份	79,229,798.00	7.74
22	601668	中国建筑	77,438,144.60	7.57
23	002851	麦格米特	76,604,690.42	7.49
24	002371	北方华创	76,251,746.76	7.45
25	300502	新易盛	76,024,545.40	7.43
26	001309	德明利	75,871,230.80	7.41
27	000651	格力电器	75,677,003.35	7.40
28	601888	中国中免	75,463,138.00	7.38
29	300059	东方财富	73,048,414.00	7.14
30	600919	江苏银行	71,871,912.00	7.02
31	300548	长芯博创	71,423,169.30	6.98
32	603228	景旺电子	69,953,843.20	6.84
33	603259	药明康德	69,244,408.16	6.77
34	301308	江波龙	68,784,196.30	6.72
35	601138	工业富联	68,025,822.00	6.65
36	600309	万华化学	66,612,186.59	6.51
37	300748	金力永磁	66,283,748.60	6.48
38	301236	软通动力	66,036,146.00	6.45
39	000568	泸州老窖	65,909,004.20	6.44
40	300450	先导智能	65,284,105.98	6.38
41	601360	三六零	64,580,203.76	6.31
42	600183	生益科技	63,849,039.99	6.24
43	002916	深南电路	62,747,570.44	6.13

44	300124	汇川技术	62,526,704.50	6.11
45	002281	光迅科技	62,405,598.82	6.10
46	002402	和而泰	61,907,816.55	6.05
47	300803	指南针	61,783,343.35	6.04
48	603083	剑桥科技	59,598,563.75	5.82
49	600938	中国海油	58,650,874.12	5.73
50	601169	北京银行	58,526,644.68	5.72
51	002812	恩捷股份	58,496,730.00	5.72
52	002074	国轩高科	57,289,675.42	5.60
53	600900	长江电力	56,009,049.50	5.47
54	600031	三一重工	55,956,431.00	5.47
55	600839	四川长虹	55,305,873.00	5.41
56	688472	阿特斯	54,525,291.37	5.33
57	300418	昆仑万维	54,359,935.13	5.31
58	600021	上海电力	54,297,602.00	5.31
59	002129	TCL 中环	53,002,354.25	5.18
60	300454	深信服	52,924,072.21	5.17
61	000792	盐湖股份	52,588,618.30	5.14
62	002326	永太科技	52,426,244.04	5.12
63	600570	恒生电子	51,547,855.79	5.04
64	601336	新华保险	50,981,614.00	4.98
65	688256	寒武纪	50,953,730.89	4.98
66	603185	弘元绿能	50,670,410.56	4.95
67	300394	天孚通信	50,587,131.89	4.94
68	601688	华泰证券	50,523,840.45	4.94
69	002738	中矿资源	50,241,445.40	4.91
70	002230	科大讯飞	50,087,229.00	4.90
71	300115	长盈精密	49,699,718.12	4.86
72	600926	杭州银行	48,738,583.96	4.76
73	300438	鹏辉能源	48,352,749.00	4.73
74	000977	浪潮信息	47,842,622.22	4.68
75	688008	澜起科技	47,603,038.86	4.65
76	301358	湖南裕能	47,402,121.73	4.63
77	300475	香农芯创	47,375,287.76	4.63
78	601869	长飞光纤	46,363,871.00	4.53
79	000338	潍柴动力	46,119,133.00	4.51
80	600699	均胜电子	45,912,441.40	4.49
81	601009	南京银行	45,396,036.89	4.44
82	300769	德方纳米	45,197,685.04	4.42
83	002459	晶澳科技	45,105,753.00	4.41
84	301511	德福科技	44,992,376.40	4.40
85	002460	赣锋锂业	44,873,101.59	4.39
86	601225	陕西煤业	43,825,067.00	4.28

87	300058	蓝色光标	42,941,999.87	4.20
88	600795	国电电力	42,463,200.00	4.15
89	600760	中航沈飞	42,447,640.10	4.15
90	603444	吉比特	42,086,963.00	4.11
91	601658	邮储银行	41,603,083.00	4.07
92	688012	中微公司	41,205,712.31	4.03
93	002222	福晶科技	40,911,473.59	4.00
94	300204	舒泰神	40,561,116.00	3.96
95	601689	拓普集团	40,369,092.92	3.95
96	000858	五粮液	40,290,470.33	3.94
97	688111	金山办公	39,897,494.51	3.90
98	300620	光库科技	39,875,289.00	3.90
99	601919	中远海控	38,712,242.30	3.78
100	688228	开普云	38,553,719.15	3.77
101	688235	百济神州	38,467,875.71	3.76
102	002436	兴森科技	38,403,106.18	3.75
103	600010	宝钢股份	37,663,408.00	3.68
104	603893	瑞芯微	37,631,340.50	3.68
105	301526	国际复材	37,458,077.00	3.66
106	601398	工商银行	37,308,301.44	3.65
107	000001	平安银行	37,028,726.00	3.62
108	688521	芯原股份	36,969,258.82	3.61
109	002050	三花智控	36,421,324.00	3.56
110	600690	海尔智家	35,244,907.91	3.44
111	000981	山子高科	35,217,799.90	3.44
112	601077	渝农商行	35,210,413.00	3.44
113	300073	当升科技	34,687,189.76	3.39
114	002131	利欧股份	34,555,483.00	3.38
115	600660	福耀玻璃	34,332,621.00	3.36
116	603019	中科曙光	33,668,014.10	3.29
117	688122	西部超导	32,264,424.97	3.15
118	600066	宇通客车	32,264,306.60	3.15
119	600519	贵州茅台	31,813,860.85	3.11
120	600111	北方稀土	31,672,819.95	3.10
121	600026	中远海能	31,248,708.00	3.05
122	300496	中科创达	29,264,049.18	2.86
123	001203	大中矿业	29,256,292.80	2.86
124	601377	兴业证券	29,038,579.13	2.84
125	688981	中芯国际	28,968,315.73	2.83
126	600120	浙江东方	28,412,206.66	2.78
127	600588	用友网络	28,102,456.00	2.75
128	002273	水晶光电	27,726,041.00	2.71
129	603119	浙江荣泰	27,581,352.95	2.70

130	601288	农业银行	26,462,939.00	2.59
131	002080	中材科技	26,409,587.71	2.58
132	601318	中国平安	25,866,888.00	2.53
133	605499	东鹏饮料	25,499,293.60	2.49
134	300782	卓胜微	25,308,009.02	2.47
135	601319	中国人保	25,256,866.50	2.47
136	002335	科华数据	25,238,141.11	2.47
137	000725	京东方 A	25,229,186.00	2.47
138	002600	领益智造	24,084,599.00	2.35
139	601162	天风证券	23,753,338.00	2.32
140	000021	深科技	23,597,495.00	2.31
141	002920	德赛西威	23,444,787.07	2.29
142	600028	中国石化	23,046,132.40	2.25
143	600019	宝钢股份	23,022,787.00	2.25
144	603920	世运电路	22,925,076.00	2.24
145	300207	欣旺达	22,871,045.00	2.24
146	300223	北京君正	22,488,175.50	2.20
147	002126	银轮股份	22,476,702.00	2.20
148	002472	双环传动	22,345,096.00	2.18
149	000157	中联重科	22,040,202.00	2.15
150	600096	云天化	22,014,801.00	2.15
151	301095	广立微	21,935,933.50	2.14
152	601872	招商轮船	21,811,914.74	2.13
153	600406	国电南瑞	21,665,483.98	2.12
154	000596	古井贡酒	21,618,534.19	2.11
155	002396	星网锐捷	21,496,173.00	2.10
156	603296	华勤技术	21,129,099.20	2.06
157	300339	润和软件	21,096,551.10	2.06
158	002049	紫光国微	20,962,247.00	2.05
159	300602	飞荣达	20,629,059.00	2.02
160	601939	建设银行	20,555,000.84	2.01

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	111,253,674.11	10.87
2	300274	阳光电源	109,667,934.81	10.72
3	600919	江苏银行	107,395,509.90	10.50
4	300014	亿纬锂能	103,781,387.69	10.14
5	600941	中国移动	101,834,574.62	9.95
6	300033	同花顺	99,419,948.00	9.72
7	002384	东山精密	98,792,075.12	9.65

8	601328	交通银行	92,857,885.00	9.07
9	000333	美的集团	89,510,051.81	8.75
10	603986	兆易创新	87,165,255.40	8.52
11	002241	歌尔股份	85,722,625.02	8.38
12	002466	天齐锂业	85,650,837.10	8.37
13	300502	新易盛	84,536,030.73	8.26
14	300548	长芯博创	81,931,414.97	8.01
15	002475	立讯精密	81,590,984.00	7.97
16	601012	隆基绿能	76,104,719.20	7.44
17	601668	中国建筑	76,102,890.00	7.44
18	600438	通威股份	74,932,050.46	7.32
19	002709	天赐材料	72,074,261.38	7.04
20	300308	中际旭创	71,676,296.95	7.00
21	601888	中国中免	67,938,866.80	6.64
22	603799	华友钴业	65,892,496.20	6.44
23	603083	剑桥科技	65,172,405.13	6.37
24	601009	南京银行	65,144,043.72	6.37
25	002851	麦格米特	65,097,078.17	6.36
26	301236	软通动力	64,892,661.25	6.34
27	300748	金力永磁	64,845,798.68	6.34
28	002402	和而泰	63,511,033.30	6.21
29	000858	五粮液	63,180,418.01	6.17
30	601688	华泰证券	62,645,084.72	6.12
31	000568	泸州老窖	62,467,763.00	6.10
32	601138	工业富联	61,982,761.54	6.06
33	300803	指南针	61,477,477.87	6.01
34	000651	格力电器	60,396,196.00	5.90
35	002281	光迅科技	60,272,843.61	5.89
36	600089	特变电工	59,285,013.68	5.79
37	001309	德明利	59,172,136.44	5.78
38	300450	先导智能	57,593,766.20	5.63
39	601169	北京银行	56,945,371.62	5.57
40	300394	天孚通信	56,696,134.78	5.54
41	600900	长江电力	56,440,740.99	5.52
42	600839	四川长虹	55,456,834.12	5.42
43	600309	万华化学	54,642,853.00	5.34
44	002460	赣锋锂业	54,194,092.94	5.30
45	601336	新华保险	54,109,220.83	5.29
46	600570	恒生电子	53,609,592.39	5.24
47	000725	京东方 A	53,201,744.00	5.20
48	688256	寒武纪	52,797,941.98	5.16
49	002916	深南电路	52,237,510.20	5.11
50	688008	澜起科技	52,059,261.41	5.09

51	300115	长盈精密	51,828,898.48	5.07
52	300124	汇川技术	51,556,530.36	5.04
53	000977	浪潮信息	51,494,043.34	5.03
54	600938	中国海油	50,371,814.00	4.92
55	002230	科大讯飞	49,064,701.00	4.80
56	300620	光库科技	47,529,027.93	4.65
57	603228	景旺电子	47,326,482.80	4.63
58	603259	药明康德	45,854,472.00	4.48
59	000338	潍柴动力	44,936,698.00	4.39
60	688012	中微公司	43,959,091.62	4.30
61	300204	舒泰神	43,692,844.47	4.27
62	603893	瑞芯微	43,466,875.30	4.25
63	600183	生益科技	43,439,483.73	4.25
64	601689	拓普集团	43,121,633.15	4.21
65	601669	中国电建	42,882,731.00	4.19
66	601658	邮储银行	42,538,458.00	4.16
67	601869	长飞光纤	42,210,387.35	4.13
68	002463	沪电股份	41,817,516.26	4.09
69	601360	三六零	41,815,191.00	4.09
70	002812	恩捷股份	41,444,508.26	4.05
71	600699	均胜电子	41,158,185.20	4.02
72	300475	香农芯创	41,116,656.81	4.02
73	000063	中兴通讯	41,015,133.36	4.01
74	688111	金山办公	41,004,996.36	4.01
75	600760	中航沈飞	40,472,967.46	3.96
76	601398	工商银行	39,876,923.79	3.90
77	601919	中远海控	39,359,162.90	3.85
78	688521	芯原股份	38,989,569.22	3.81
79	600015	华夏银行	38,949,836.66	3.81
80	688235	百济神州	38,676,881.28	3.78
81	002050	三花智控	38,368,158.00	3.75
82	601006	大秦铁路	37,985,315.00	3.71
83	002131	利欧股份	37,917,006.65	3.71
84	688228	开普云	37,713,788.05	3.69
85	002459	晶澳科技	37,341,180.10	3.65
86	601225	陕西煤业	37,148,032.60	3.63
87	301358	湖南裕能	36,955,475.90	3.61
88	601077	渝农商行	36,778,272.10	3.59
89	301511	德福科技	36,170,700.80	3.53
90	000001	平安银行	36,118,560.00	3.53
91	300454	深信服	36,020,265.32	3.52
92	603019	中科曙光	35,315,734.64	3.45
93	002436	兴森科技	34,907,290.59	3.41

94	600690	海尔智家	34,890,505.31	3.41
95	002738	中矿资源	34,889,122.55	3.41
96	600660	福耀玻璃	34,080,899.11	3.33
97	000981	山子高科	32,442,127.00	3.17
98	688981	中芯国际	32,276,012.61	3.15
99	603444	吉比特	31,902,246.64	3.12
100	601111	中国国航	31,726,796.00	3.10
101	600111	北方稀土	31,567,628.00	3.09
102	301308	江波龙	31,558,628.18	3.08
103	002371	北方华创	31,047,720.30	3.03
104	688122	西部超导	30,358,969.85	2.97
105	600887	伊利股份	30,315,134.90	2.96
106	601377	兴业证券	30,302,842.50	2.96
107	000021	深科技	29,596,600.00	2.89
108	002326	永太科技	29,460,556.00	2.88
109	002335	科华数据	29,421,223.52	2.88
110	600120	浙江东方	29,412,528.74	2.87
111	300496	中科创达	29,072,408.85	2.84
112	300769	德方纳米	28,970,766.80	2.83
113	603119	浙江荣泰	28,544,936.00	2.79
114	002273	水晶光电	27,209,715.28	2.66
115	002129	TCL 中环	27,103,807.00	2.65
116	002074	国轩高科	27,059,036.00	2.64
117	600926	杭州银行	27,030,082.51	2.64
118	601288	农业银行	26,743,465.00	2.61
119	600588	用友网络	26,718,462.00	2.61
120	603185	弘元绿能	26,341,645.68	2.57
121	601318	中国平安	26,170,128.00	2.56
122	002472	双环传动	26,115,977.31	2.55
123	601162	天风证券	25,547,996.00	2.50
124	300207	欣旺达	25,496,848.00	2.49
125	002600	领益智造	25,405,013.00	2.48
126	002222	福晶科技	25,215,977.60	2.46
127	600019	宝钢股份	24,347,470.00	2.38
128	002920	德赛西威	24,243,666.19	2.37
129	002415	海康威视	23,866,055.37	2.33
130	600031	三一重工	23,851,670.00	2.33
131	300782	卓胜微	23,778,312.52	2.32
132	300223	北京君正	23,554,222.50	2.30
133	600096	云天化	23,489,624.00	2.30
134	600519	贵州茅台	23,426,374.00	2.29
135	301526	国际复材	23,400,623.00	2.29
136	002049	紫光国微	23,270,208.00	2.27

137	603920	世运电路	23,038,151.00	2.25
138	600028	中国石化	22,828,247.60	2.23
139	000596	古井贡酒	22,682,374.00	2.22
140	601872	招商轮船	22,435,808.61	2.19
141	600026	中远海能	22,274,547.00	2.18
142	002126	银轮股份	21,982,962.90	2.15
143	300602	飞荣达	21,946,328.05	2.14
144	300418	昆仑万维	21,935,344.00	2.14
145	002080	中材科技	21,761,867.51	2.13
146	600406	国电南瑞	21,674,094.56	2.12
147	688472	阿特斯	21,237,132.37	2.08
148	600066	宇通客车	20,919,561.25	2.04
149	603296	华勤技术	20,854,773.87	2.04
150	300339	润和软件	20,838,002.40	2.04
151	601939	建设银行	20,834,348.85	2.04

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,885,400,300.09
卖出股票收入（成交）总额	10,325,558,896.63

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

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

无

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

无

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

无

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

无

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,047,261.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,047,261.20

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
国金智享 量化选股 混合 A	8,132	58,158.19	104,872,268.14	22.17	368,070,170.86	77.83
国金智享 量化选股 混合 C	62,460	28,511.73	617,419,321.10	34.67	1,163,423,188.70	65.33
合计	70,592	31,926.92	722,291,589.24	32.05	1,531,493,359.56	67.95

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金智享量化选股混合 A	1,089,753.05	0.2304
	国金智享量化选股混合 C	76,516.51	0.0043
	合计	1,166,269.56	0.0517

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	国金智享量化选股混合 A	0~10
	国金智享量化选股混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国金智享量化选股混合 A	0~10
	国金智享量化选股混合 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金智享量化选股混合 A	国金智享量化选股混合 C
基金合同生效日 (2023 年 8 月 22 日) 基金份额总额	847,202,079.90	1,144,845,934.37

本报告期期初基金份额总额	465,678,346.10	600,395,578.25
本报告期基金总申购份额	419,672,496.05	2,496,638,041.61
减：本报告期基金总赎回份额	412,408,403.15	1,316,191,110.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	472,942,439.00	1,780,842,509.80

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为 65,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	22,210,959,196.72	100.00	9,684,638.67	100.00	-

注：（一）选择标准

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

（二）选择程序

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

##### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	-	-	2,868,213,000.00	100.00	-	-

#### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	《国金智享量化选股混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 17 日
2	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 A 份额）基金产品资料概要更新》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 17 日
3	《国金智享量化选股混合型证券投资基金（国金智享量化选股混合 C 份额）基金产品资料概要更新》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 17 日
4	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日
5	《国金基金管理有限公司关于关闭微信交易平台的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 2 月 7 日
6	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 2 月 20 日
7	《国金基金管理有限公司关于终止厦门市鑫鼎盛控股有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 11 日
8	《关于国金基金管理公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 20 日
9	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2024 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
10	《国金基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 31 日
11	《国金基金管理有限公司关于运用公司自有资金和高级管理人员自有资金投资旗下权益基金的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 14 日
12	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
13	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 25 日
14	《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	2025 年 7 月 1 日
15	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 19 日
16	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2025 年中期报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 8 月 30 日
17	《国金智享量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 10 月 28 日
18	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 12 月 19 日

	告》		
19	《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	2025 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

无

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日