

# 国恩中证 1000 指数增强 1 号私募证券投资基金 2023 年年度报告

## 1、基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

基金名称	国恩中证 1000 指数增强 1 号私募证券投资基金
基金编码	SNE072
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020 年 11 月 09 日
基金管理人	深圳前海国恩资本管理有限公司
基金托管人（如有）	中信建投证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	6,992.209217
基金到期日期	2035 年 11 月 08 日

### 1.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争为基金投资者创造稳健的收益和回报。
投资策略	1、指数增强投资策略：本基金对标中证 1000 指数，主策略为 1000 指数增强策略，在整个市场体系内，通过量化的多因子模型来筛选股票，多点投注、降低风险，利用行为因子非线性动力特征力争构建能稳定获得超额收益的现货组合。2、其他策略：本基金将根据市场变化和管理人的判断，投资本基金投资范围内约定的投资品种、投资工具等，力争实现基金资产的稳步增值。
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本基金属于【R4】级基金产品，适合专业投

	资者及风险承受能力为【C4、C5】型的普通合格投资者。
--	-----------------------------

### 1.3 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		深圳前海国恩资本管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李向东	范金茹
	联系电话	0755-23902504	010-86451131
	电子邮箱	gezb@gncapital.net.cn	tgguzhi@csc.com.cn
传真		-	010-85130975
注册地址		广东省深圳市南山区前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址		广东省深圳市福田区深圳市福田区香蜜湖深南香蜜立交西南侧深铁置业大厦第36层3606-07号房	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心
邮政编码		518000	100010
法定代表人		李向东	王常青

### 1.4 信息披露方式

1. 传真、电子邮件、微信、电话或其他通讯方式；2. 邮寄服务；3. 基金管理人网站；4. 基金管理人指定的其他信息披露途径或方式；5. 法律法规、监管机构允许的其他信息披露途径或方式。

### 1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址

会计师事务所	-	-
注册登记机构	中信建投证券股份有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号
外包机构	中信建投证券股份有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号

## 2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	270,640.34	1,720,380.83	1,733,409.77
本期利润	4,666,602.26	-2,204,383.73	1,903,184.65
期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	46,209,836.21	29,616,417.72	1,506,020.62
期末可供分配基金份额利润	0.6609	0.5508	0.3844
期末基金净资产	116,978,182.46	83,390,139.50	5,594,130.98
报告期期末单位净值	1.673	1.551	1.428
累计期末指标	2023年末	2022年末	2021年末
基金份额累计净值增长率(%)	67.30	55.10	42.80

● 无分级 ○二级 ○三级

### 2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
当年	7.87			

自基金合同生效起至今	67.30			
------------	-------	--	--	--

### 2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023	0	0.00	0.00	0.00	-
2022	0	0.00	0.00	0.00	-
2021	0	0.00	0.00	0.00	-

### 3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	5,377.372178
报告期期间基金总申购份额	9,160.816166
减：报告期期间基金总赎回份额	7,545.979127
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	6,992.209217

### 4、管理人说明的其他情况

--

### 5、托管人报告（如有）

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管基金过程中，严格遵守了基金合同、托管协议（如有）的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，托管人按照基金合同，托管协议（如有）的有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用进行了认真的复核；托管人按照基金合同或托管协议（如有）中约定的托管人应承担的投资监督职责，根据基金管理人向托管人提供的基金投资相关文件及基金托管账户显示的基金投资信息，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有明显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

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现的相关内容，所复核内容真实、准确和完整。免责声明：1、基金托管人仅复核本报告中的基金财务数据，对于本报告中基金财务数据以外的其他数据和信息，基金托管人不承担复核职责。2、基金管理人，基金管理人委托的证券期货经纪商等服务机构应当确保向基金托管人提供的基金财务数据和信息的及时性、真实性、准确性和完整性，对因基金管理人或者服务机构原因导致基金托管人复核后的基金财务数据不准确及基金财产损失，基金托管人不承担任何责任。3、基金托管人不复核本基金财产分配（包括利润分配、收益分配及资产分配等）情况，除非基金合同或托管协议（如有）明确约定由基金托管人对财产分配（包括利润分配、收益分配及资产分配等）情况进行复核。4、若该产品为单笔计提业绩报酬，具体暂估业绩报酬金额以注册登记机构计算结果为准，基金托管人不承担复核义务。

### 6、年度财务报表

金额单位：元

#### 6.1 资产负债表

资产	本期末 2023-12-31	上年度末 2022-12-31
资产：		
银行存款	33,799.13	8,931.53
结算备付金	8,266,344.38	100.01
存出保证金	0.00	2,888,531.21
交易性金融资产	117,940,446.24	80,686,519.32

其中：股票投资	117,940,446.24	80,686,519.32
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	126,240,589.75	83,584,082.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2023-12-31</b>	<b>上年度末 2022-12-31</b>
负债：		
短期借款	8,642,482.37	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	596,442.42	187,686.35

应付托管费	9,940.71	3,128.11
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	13,541.79	3,128.11
负债合计	9,262,407.29	193,942.57
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	69,922,092.17	53,773,721.78
未分配利润	47,056,090.29	29,616,417.72
所有者权益合计	116,978,182.46	83,390,139.50
负债和所有者权益总计	126,240,589.75	83,584,082.07

## 6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2023-01-01 至 2023-12-31	2022-01-01 至 2022-12-31
<b>一、收入</b>	11,736,402.55	-1,085,614.80
1. 利息收入	27,064.75	7,224.54
其中：存款利息收入	12,498.51	3,261.19
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	11,525.14	4,082.30

其他利息收入	3,041.10	-118.95
2. 投资收益（损失以“-”填列）	7,667,223.54	2,927,760.27
其中：股票投资收益	5,829,593.87	2,771,691.30
基金投资收益	0.00	6.10
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	1,837,629.67	156,062.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	4,395,961.92	-3,925,377.96
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-353,847.66	-95,221.65
<b>减：二、费用</b>	<b>7,069,800.29</b>	<b>1,118,768.93</b>
1. 管理人报酬	3,355,365.67	484,007.75
其中：固定管理费	2,302,215.47	336,767.07
业绩报酬	1,053,150.20	147,240.68
2. 托管费	38,370.24	5,612.78
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	38,370.24	5,612.78
5. 交易费用	3,510,518.32	611,868.12
6. 利息支出	82,442.93	0.00



其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	44,732.89	11,667.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,666,602.26	-2,204,383.73
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,666,602.26	-2,204,383.73

备注：-

### 6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2023-01-01 至 2023-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	53,773,721.78	29,616,417.72	83,390,139.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	4,666,602.26	4,666,602.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	16,148,370.39	12,773,070.31	28,921,440.70
其中：1. 基金申购款	91,608,161.66	62,041,838.34	153,650,000.00
2. 基金赎回款	-75,459,791.27	-49,268,768.03	-124,728,559.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	69,922,092.17	47,056,090.29	116,978,182.46

项目	上年度可比期间 2022-01-01 至 2022-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	3,917,727.72	1,676,403.26	5,594,130.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	0.00	-2,204,383.73	-2,204,383.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	49,855,994.06	30,144,398.19	80,000,392.25
其中：1. 基金申购款	57,364,309.43	34,235,690.57	91,600,000.00
2. 基金赎回款	-7,508,315.37	-4,091,292.38	-11,599,607.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益 (基金净值)	53,773,721.78	29,616,417.72	83,390,139.50

## 7、 期末投资组合情况

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	33,799.13
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	
	其他股权类投资	

上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	8,266,344.38
	存出保证金	0.00
	股票投资	117,940,446.24
	债券投资	0.00
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	0.00
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	0.00
	买入返售金融资产	0.00
	其他证券类标的	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	
	信托计划投资	
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
	保险资产管理计划投资	
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	

	私募基金产品投资	
	未在协会备案的合伙企业份额	
另类投资	另类投资	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	
	信托贷款	
	应收账款投资	
	各类受（收）益权投资	
	票据（承兑汇票等）投资	
	其他债权投资	
境外投资	境外投资	
其他资产	其他资产	
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	8,642,482.37
	其中：融券总额	
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	808,164.00	0.69

B	采矿业	3,680,858.00	3.15
C	制造业	76,387,765.76	65.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,432,223.00	3.79
E	建筑业	2,905,620.00	2.48
F	批发和零售业	4,969,732.00	4.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,168,687.00	1.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,926,183.48	7.63
J	金融业	2,416,613.00	2.07
K	房地产业	2,434,819.00	2.08
L	租赁和商务服务业	452,565.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	872,899.00	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	210,362.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	388,208.00	0.33
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,885,747.00	6.74
S	综合	0.00	0.00
	合计	117,940,446.24	100.82

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
港股通	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

信息披露报告是否经托管机构复核：是